

NEUBERGER BERMAN



**NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC**  
**JAHRESBERICHT 2022**

GEPRÜFTER JAHRESABSCHLUSS  
FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

# Inhaltsverzeichnis

	SEITE
<b>GESCHÄFTSFÜHRUNG UND VERWALTUNG</b>	1
<b>ALLGEMEINE INFORMATIONEN</b>	3
<b>BERICHT DER DIREKTOREN</b>	45
<b>BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER</b>	52
<b>BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE GESELLSCHAFTER DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC</b>	53
<b>BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE DIREKTOREN DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC</b>	56
<b>BERICHT DES INVESTMENT-MANAGERS</b>	58
<b>AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS</b>	
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (oder „5G Connectivity“)	118
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (oder „Absolute Return Multi Strategy“)	123
Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund (oder „Asian Debt - Hard Currency“)	124
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (oder „China A-Share Equity“)	129
Neuberger Berman China Bond Fund (oder „China Bond“)	131
Neuberger Berman China Equity Fund (oder „China Equity“)	134
Neuberger Berman CLO Income Fund (oder „CLO Income“)	137
Neuberger Berman Commodities Fund (oder „Commodities“)	141
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (oder „Corporate Hybrid Bond“)	144
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Hard Currency“)	149
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Local Currency“)	161
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Blend“)	175
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend“)	197
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (oder „Emerging Markets Equity“)	210
Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund (oder „Emerging Markets Select Equity“ (ehemals: „Emerging Markets Sustainable Equity“)	216
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (oder „Euro Bond Absolute Return“)	220

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

	SEITE
Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (oder „Euro Opportunistic Bond“)	227
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (oder „European High Yield Bond“)	232
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (oder „European Sustainable Equity“)	239
Neuberger Berman Event Driven Fund (oder „Event Driven“)	241
Neuberger Berman Global Bond Fund (oder „Global Bond“)	243
Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (oder „Global Diversified Income FMP – 2024“)	263
Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (or “Global Equity Megatrends“) (ehemals: „Global Thematic Equity“)	267
Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (oder „Global Flexible Credit Income“) (formerly: „Global Flexible Credit“)	269
Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund (oder „Global High Yield SDG Engagement“) (ehemals: „Global High Yield Bond“)	282
Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (oder „Global High Yield Sustainable Action“)	297
Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (oder „Global Investment Grade Credit“)	303
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (oder „Global Opportunistic Bond“)	311
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (oder „Global Real Estate Securities“)	331
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (oder „Global Sustainable Equity“)	335
Neuberger Berman High Yield Bond Fund (oder „High Yield Bond“)	337
Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (oder „InnovAsia 5G“)	353
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (oder „Japan Equity Engagement“)	357
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (oder „Macro Opportunities FX“)	360
Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (oder „Multi-Asset Income“)	365
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (oder „Next Generation Mobility“)	385
Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (oder “Next Generation Space Economy“)	389
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (oder „Short Duration Emerging Market Debt“)	391
Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (oder „Short Duration High Yield SDG Engagement“) (ehemals: „Short Duration High Yield Bond“)	404

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

	SEITE
Neuberger Berman Strategic Income Fund (oder „Strategic Income“)	414
Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (oder „Sustainable Asia High Yield“)	443
Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (oder „Sustainable Emerging Market Corporate Debt“) (ehemals: „Emerging Market Corporate Debt“)	447
Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency“)	458
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund (oder „Systematic Global Sustainable Value“)	463
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (oder „Ultra Short Term Euro Bond“)	473
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (oder „Uncorrelated Strategies“)	483
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	664
Neuberger Berman US Equity Fund (oder „US Equity“)	773
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund (oder „US Equity Index PutWrite“)	776
Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (oder „US Large Cap Value“)	779
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (oder „US Long Short Equity“)	783
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (oder „US Multi Cap Opportunities“)	792
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (oder „US Real Estate Securities“)	795
Neuberger Berman US Small Cap Fund (oder „US Small Cap“)	799
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (oder „US Small Cap Intrinsic Value“)	804
<b>BILANZEN</b>	807
<b>GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG</b>	821
<b>AUFSTELLUNG ÜBER DIE ENTWICKLUNG DES AUF INHABER RÜCKZAHLBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS</b>	835
<b>AUFSTELLUNG DER WESENTLICHEN KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)</b>	843

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

	SEITE
<b>ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS</b>	964
Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze	964
Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	973
Barmittel und Barmitteläquivalente	1004
Kontenüberziehung	1024
Anteilkapital	1024
Gebühren des Managers, der Verwaltungsstelle, der Vertriebsstelle und der Verwahrstelle	1170
Honorare und Aufwendungen der Direktoren	1191
Vergütung der Abschlussprüfer	1191
Sonstige Gebühren und Kosten	1191
Transaktionen verbundener Parteien	1192
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	1211
Angaben zu Finanzinstrumenten	1240
Vergleichszahlen für den Nettoinventarwert	1399
Wechselkurse	1507
Berichtigung der Währungsumrechnung	1508
Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions)	1509
Getrennte Haftung	1509
Effizientes Portfoliomanagement	1509
Kreditfazilität	1510
Ungedeckte Kreditzusagen	1511
Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres	1511
Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres	1512
Sonstige Sachverhalte	1513
Genehmigung des Abschlusses	1513
Finanzkennzahlen	1514
Derivative Kontrakte	1672
Saldierung von Finanzinstrumenten	1691
Geschlossene Fonds	1780
<b>ANHANG I – GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT)</b>	1781
<b>ANHANG II – PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT)</b>	1809
<b>ANHANG III – INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT)</b>	1836
<b>ANHANG IV – VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT)</b>	1838
<b>ANHANG V – ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT)</b>	1861
<b>ANHANG VI – GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)</b>	1862
<b>ANHANG VII – INVESTMENT-MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT)</b>	1868
<b>ANHANG VIII – OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT)</b>	1871

## Geschäftsführung und Verwaltung

### Direktoren:

Tom Finlay (Ire)\*\*  
 Gráinne Alexander (Irin)\*\*\*  
 Michelle Green (Britin)\*  
 Naomi Daly (Irin)\*\*\*  
 Alex Duncan (Brite)\*

\*Nicht geschäftsführender Direktor

\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und ständiger Vorsitzender

\*\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor

### Rechtsberater für irisches Recht:

Matheson LLP  
 70 Sir John Rogerson's Quay  
 Dublin 2  
 Irland

### Verwahrstelle:

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited  
 30 Herbert Street  
 Dublin 2  
 Irland

### Manager:

Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited  
 Vor dem 1. Januar 2023:  
 32 Molesworth Street  
 Dublin 2  
 Irland

Seit dem 1. Januar 2023:

2 Central Plaza  
 Dame Street  
 Dublin 2  
 Irland  
 D02 T0X4

### Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager:

Neuberger Berman Asia Limited  
 20<sup>th</sup> Floor  
 Jardine House  
 1 Connaught Place  
 Central Hong Kong

Neuberger Berman Singapore Pte. Limited  
 Stufe 15  
 Ocean Financial Centre  
 10 Collyer Quay  
 Singapur 049315

### Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager (Fortsetzung):

Neuberger Berman Europe Limited  
 The Zig Zag Building  
 70 Victoria Street  
 London SW1E 6SQ  
 England

### Vertriebsstelle:

Neuberger Berman BD LLC  
 1290 Avenue of the Americas  
 New York, NY 10104-0002  
 USA

### Nicht verbundener Unterberater:

Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited  
 Room B01 of Units 4205, 4206 and 4207  
 No.479 Lujiazui Ring Road  
 China (Shanghai) Pilot Free Trade Zone, 200120  
 Republik China

### Verwaltungsstelle:

Brown Brothers Harriman Fund  
 Administration Services (Ireland) Limited  
 30 Herbert Street  
 Dublin 2  
 Irland

### Unabhängige Wirtschaftsprüfer:

Ernst & Young  
 Chartered Accountants  
 Harcourt Centre  
 Harcourt Street  
 Dublin 2  
 Irland

### Vertreter in der Schweiz:\*\*\*\*

BNP Paribas Securities Services S.A. Paris  
 Succursale de Zürich  
 Selnaustrasse 16  
 P.O. Box 2119 CH-8002  
 Zürich  
 Schweiz

\*\*\*\*Der Verkaufsprospekt, die Satzung, die Wesentlichen Anlegerinformationen, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie ein Verzeichnis aller Käufe und Verkäufe, die innerhalb des Berichtszeitraums erfolgten, sind kostenlos beim Vertreter in der Schweiz erhältlich.

## Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

### Secretary des Fonds und eingetragener Geschäftssitz:

Matsack Trust Limited  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
Irland

### Sub-Investment-Manager:

Neuberger Berman Investment Advisers LLC  
1290 Avenue of the Americas  
New York, NY 10104-0002  
USA

Neuberger Berman Canada ULC  
2 Bloor Street East Suite 2830  
Toronto, ON M4W 1A8  
Kanada

Neuberger Berman Alternatives Advisers LLC  
325 N Saint Paul Street, Suite 4900  
Dallas, TX 75201  
USA

Neuberger Berman East Asia Limited  
351 Manunouchi 1-Chrome  
Chiyoda-ku  
Tokio  
Japan

### Hauptvertreter und Vertriebsstelle in Taiwan:

Neuberger Berman Taiwan (SITE) Limited  
20F., Not. 68, See 5, Zhongxiao E. Road  
XinYi District  
Taipei City 110  
Taiwan  
Republik China

### Nicht verbundene Unterberater:

Green Court Capital Management Limited  
20<sup>th</sup> Floor  
Jardine House  
1 Connaught Place  
Central Hong Kong

Altiq LLP  
29 Farm Street  
London W1J 5RL  
Großbritannien

BH-DG Systematic Trading LLP  
20 North Audley Street  
London W1K 6LX  
Großbritannien

### Nicht verbundene Unterberater (Fortsetzung):

True Partner Capital USA Holding Inc  
111 West Jackson Boulevard, Suite 1700  
Chicago, IL 60604  
USA

Alcova Asset Management LLP  
21 Knightsbridge  
London SW1X 7LY  
Großbritannien

Sandbar Asset Management LLP  
Warnford Court  
14-15 Conduit Street  
London W1S 2XJ  
Großbritannien

P/E Global LLC  
75 State Street, 31st Floor  
Boston, MA 02109  
USA

Crabel Capital Management, LLC  
10250 Constellation Blvd., Suite 2650  
Los Angeles, CA 90067  
USA

AllianceBernstein LP  
1345 Avenue of the Americas  
New York, NY 10105  
USA

Portman Square Capital  
4th Floor Reading Bridge House  
George Street  
Reading, Berkshire  
RG1 8LS  
Großbritannien

Soloda Investment Advisors LLP  
3<sup>rd</sup> Floor Strand Bridge House  
138-142 Strand London WC2R 1HH  
Großbritannien

## Allgemeine Informationen

Die folgenden Informationen wurden aus dem Verkaufsprospekt übernommen und sollten in Verbindung mit dem vollständigen Text des Verkaufsprospekts und den dort aufgeführten Definitionen gelesen werden.

Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) ist ein Investmentfonds mit variablem Kapital, der am 11. Dezember 2000 in Irland gemäß des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) unter der Registernummer 336425 als Aktiengesellschaft gegründet wurde. Der Fonds wurde von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als ein Organismus für Gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Bestimmungen EG-Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Vorschriften“) genehmigt. Der Fonds besitzt die Struktur eines Umbrella-Fonds, bei dem das Anteilkapital in verschiedene Anteilserien unterteilt ist und jede Anteilserie ein separates Anlageportfolio bildet („Portfolio“). Die Anteile eines Portfolios können in verschiedene Klassen unterteilt werden, um die Möglichkeit unterschiedlicher Zeichnungs- und/oder Rücknahmegebühren und/oder Dividenden und/oder Kosten und/oder Gebührenvereinbarungen und/oder Währungen, einschließlich unterschiedlicher Gesamtkostenquoten (TER), zu schaffen. Wie im Abschnitt „Geschäftsführung und Verwaltung“ des Prospekts beschrieben, haben die Direktoren Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) am 1. Juli 2021 zum Manager bestellt, um die laufenden Geschäfte des Fonds in Übereinstimmung mit den Anforderungen der Zentralbank zu führen.

Am 31. Dezember 2022 umfasste der Fonds 54 separate Anlageportfolios („Portfolios“), die jeweils eine separate Serie rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile repräsentierten. Diese werden in der nachstehenden Tabelle angegeben:

Portfolio	Auflegungsdatum*
5G Connectivity <sup>1</sup>	8. April 2020
Asian Debt – Hard Currency <sup>1</sup>	29. Juni 2015
China A-Share Equity <sup>2</sup>	28. Juli 2020
China Bond <sup>1</sup>	28. August 2015
China Equity <sup>1</sup>	14. Juli 2009
CLO Income <sup>2</sup>	12. Juli 2018
Commodities <sup>2</sup>	9. Februar 2022
Corporate Hybrid Bond <sup>2</sup>	19. November 2015
Emerging Market Debt – Hard Currency <sup>1</sup>	31. Mai 2013
Emerging Market Debt – Local Currency <sup>1</sup>	28. Juni 2013
Emerging Market Debt Blend <sup>1</sup>	23. April 2014
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend <sup>2</sup>	10. Juli 2017
Emerging Markets Equity <sup>1</sup>	4. Oktober 2010
Emerging Markets Select Equity <sup>2</sup>	24. Oktober 2017
Euro Bond Absolute Return <sup>2</sup>	29. November 2018
Euro Opportunistic Bond <sup>2</sup>	14. November 2018
European High Yield Bond <sup>1</sup>	27. Juni 2014
European Sustainable Equity <sup>1</sup>	24. Februar 2021
Event Driven <sup>2</sup>	26. Oktober 2022
Global Bond <sup>1</sup>	16. Juli 2012
Global Diversified Income FMP – 2024 <sup>2</sup>	22. Juni 2020
Global Equity Megatrends <sup>2</sup>	27. April 2018
Global Flexible Credit Income <sup>2</sup>	1. Juni 2020
Global High Yield SDG Engagement <sup>2</sup>	4. August 2016
Global High Yield Sustainable Action <sup>2</sup>	21. Januar 2020
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	1. September 2021
Global Opportunistic Bond <sup>2</sup>	20. Dezember 2016
Global Real Estate Securities <sup>1</sup>	30. Dezember 2014



## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Portfolio	Auflegungsdatum*
Global Sustainable Equity <sup>1</sup>	24. Februar 2021
High Yield Bond <sup>1</sup>	3. Mai 2006
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	14. Juli 2021
Japan Equity Engagement <sup>2</sup>	12. Mai 2020
Macro Opportunities FX <sup>2</sup>	4. Dezember 2019
Multi-Asset Income <sup>2</sup>	28. Dezember 2016
Next Generation Mobility <sup>1</sup>	21. August 2018
Next Generation Space Economy <sup>1</sup>	10. Mai 2022
Short Duration Emerging Market Debt <sup>1</sup>	31. Oktober 2013
Short Duration High Yield SDG Engagement <sup>1</sup>	20. Dezember 2011
Strategic Income <sup>1</sup>	26. April 2013
Sustainable Asia High Yield <sup>1</sup>	13. Dezember 2021
Sustainable Emerging Market Corporate Debt <sup>1</sup>	14. Juni 2013
Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency <sup>2</sup>	19. Januar 2022
Systematic Global Sustainable Value <sup>2</sup>	18. Dezember 2014
Ultra Short Term Euro Bond <sup>2</sup>	31. Oktober 2018
Uncorrelated Strategies <sup>2</sup>	22. Mai 2017
XXXXXXXXXXXXXXXXXX <sup>2</sup>	14. Juni 2022
US Equity <sup>2</sup>	18. Dezember 2015
US Equity Index PutWrite <sup>2</sup>	30. Dezember 2016
US Large Cap Value <sup>2</sup>	20. Dezember 2021
US Long Short Equity <sup>2</sup>	28. Februar 2014
US Multi Cap Opportunities <sup>1</sup>	13. Juni 2006
US Real Estate Securities <sup>1</sup>	1. Februar 2006
US Small Cap <sup>1</sup>	1. Juli 2011
US Small Cap Intrinsic Value <sup>2</sup>	30. April 2015

\*Erster Tag des Geschäftsbetriebs.

<sup>1</sup> Das Portfolio ist von der Hong Kong Securities and Futures Commission (die „SFC“) autorisiert und kann somit für die Öffentlichkeit in Hongkong angeboten werden.

<sup>2</sup> Das Portfolio ist von der Securities and Futures Commission (SFC) nicht zugelassen und für Anleger in Hongkong nicht verfügbar

Für den Fonds besteht eine getrennte Haftung zwischen seinen Teilfonds. Dementsprechend sind sämtliche Verbindlichkeiten, die im Namen eines Teilfonds eingegangen werden bzw. einem Teilfonds zuzurechnen sind, ausschließlich aus dem Vermögen des betreffenden Teilfonds zu begleichen.

Der Neuberger Berman Diversified Currency Fund (oder „Diversified Currency“), der Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund (oder „Multi-Style Premia“), der Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (oder „Absolute Return Multi Strategy“) und der Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund (oder „Global Equity Index PutWrite“) wurden am 22. Januar 2021, 24. Februar 2021, 20. Dezember 2021 bzw. 20. Dezember 2021 aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Neuberger Berman US Large Cap Growth Fund, Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund, Neuberger Berman Global Equity Fund, Neuberger Berman Absolute Alpha Fund, Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund und Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Neuberger Berman Global Credit Long Short Fund, Neuberger Berman Global Dynamic Asset Allocator Fund, Neuberger Berman Asian Opportunities Fund, Neuberger Berman Multi-Asset Risk Premia Fund und Neuberger Berman China A-Share Opportunities Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und von der Zentralbank am 9. November 2021 widerrufen. Der Neuberger Berman Global Equity Income Fund, der Neuberger Berman Global Long Short Equity Fund, der Neuberger Berman Long Short Multi Manager Fund und der Neuberger Berman World Equity Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst, und ihre Zulassung wurde von der irischen Zentralbank am 11. Oktober 2022 widerrufen.

Die vollständige Liste der Manager, Sub-Investment-Manager und Unterberater für jedes Portfolio finden Sie in Anhang VII.

Nähere Angaben zur Sustainable Finance Disclosure Regulation entnehmen Sie bitte Anhang VIII.

Anlageziele und eine Liste der aktiven Anteilklassen der Portfolios, die zum 31. Dezember 2022 zur Anlage verfügbar waren, sind im folgenden beschrieben:

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### 5G Connectivity

Das Anlageziel des 5G Connectivity (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung einer durchschnittlichen Zielrendite von 3-5 % über dem MSCI All-Country World Index vor Gebühren über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3 Jahre).

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden. Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende (im Folgenden „Geschäftsjahresende“ oder „das beendete Geschäftsjahr“) aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse AUD A <sup>1</sup>	20. Mai 2020	AUD
Thesaurierende Klasse CNY A	1. Februar 2021	CNY
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	13. Mai 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	22. April 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	30. Juni 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	12. Juni 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	1. September 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	22. April 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP A <sup>1</sup>	15. Mai 2020	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	2. November 2020	GBP
Thesaurierende Klasse HKD A <sup>1</sup>	13. Mai 2020	HKD
Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>	14. Mai 2020	SGD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	4. Mai 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I	8. April 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I	8. April 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	10. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	6. November 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	7. Mai 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD M	2. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	19. März 2021	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Asian Debt – Hard Currency

Das Anlageziel des Asian Debt – Hard Currency (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe risikobereinigte Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus auf Hartwährungen lautenden, in Asien emittierten Schuldtiteln zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen, staatlichen Stellen oder Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Ländern Asiens haben oder dort einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben, emittiert werden und die auf Hartwährungen lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	30. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	30. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	15. Oktober 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD I	30. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD I	30. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	23. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I4	23. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	14. August 2019	USD
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	23. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD X	8. Juni 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	12. Dezember 2022	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### China A-Share Equity

Das Anlageziel des China A-Share Equity (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung von langfristigem Kapitalzuwachs, überwiegend durch die Anlage in ein Portfolio aus chinesischen A-Aktien, die ein Engagement an der wirtschaftlichen Entwicklung der Volksrepublik China (die „VRC“) bieten.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es über die Stock Connects und über die RQFII-Quota direkt in chinesische A-Aktien und indirekt, hauptsächlich durch Anlagen in eigenkapitalbezogene Wertpapiere, die von internationalen Investmentbanken begeben werden, sowie ebenfalls durch Aktien- und Schuldtitel, die von Unternehmen ausgegeben werden können, die von verbundenen Unternehmen des Sub-Investment-Managers verwaltet werden, investiert.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse CNY I	28. Juli 2020	CNY
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28. Juli 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28. Juli 2020	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### China Bond

Das Anlageziel des China Bond (das „Portfolio“) ist es, eine attraktive, risikobereinigte Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen, indem er in festverzinsliche Instrumente aus China in lokaler Währung investiert.

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die innerhalb der VRC durch die Regierung der VRC, staatliche Stellen der VRC oder Unternehmen, die ihren Hauptsitz in der VRC haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in der VRC ausüben, emittiert werden und die auf die Währung der PRC lauten oder über die RQFII-Quote (Renminbi Qualified Foreign Institutional Investor) in der Währung der VRC engagiert sind. Anleger des Portfolios sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	Auflegungsdatum der Anteilklasse	Währung
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) <sup>1</sup>	4. November 2020	CNY
Ausschüttende Klasse CNY I <sup>1</sup>	8. Juni 2018	CNY
Thesaurierende Klasse CNY Z	8. September 2015	CNY
Thesaurierende Klasse GBP I2	9. Februar 2021	GBP
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	12. März 2019	SGD
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	8. September 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	29. März 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	10. April 2018	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### China Equity

Das Anlageziel des China Equity (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer möglichst hohen Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Wertzuwachs) am Aktienmarkt Großchinas. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio überwiegend in Dividendenpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen ausgegeben werden, die:

- nach den Gesetzen der Volksrepublik China („VRC“), der Sonderverwaltungszone („SAR“) Hongkong, der Sonderverwaltungszone („SAR“) Macau oder Taiwans (der „Großraum China“) gegründet wurden oder nach diesen Gesetzen organisiert sind oder dort ihren Hauptsitz haben;
- einen Großteil ihres Gesamtumsatzes oder -gewinns grundsätzlich aus (a) Waren, die im Großraum China hergestellt oder verkauft werden, (b) Investments, die im Großraum China getätigt werden, oder (c) Dienstleistungen, die im Großraum China erbracht werden, generieren, oder
- grundsätzlich die Mehrheit ihres Vermögens im Großraum China halten (jeweils ein „großchinesisches Unternehmen“).

Das Portfolio kann auch in hybride Wertpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere, wie z. B. Wandelschuldverschreibungen, wandelbare Vorzugsaktien, Optionsanleihen, einschließlich derivativer Finanzinstrumente (FDI), investieren, die von großchinesischen Unternehmen ausgegeben werden oder eine Beteiligung an der Performance großchinesischer Unternehmen ermöglichen.

Zur Klarstellung wird festgehalten, dass das Portfolio in Wertpapiere wie hier beschrieben investieren kann, die von großchinesischen Unternehmen, welche an anerkannten Märkten außerhalb des Großraums China notiert sind oder gehandelt werden, unter anderem auch in den USA, Großbritannien, Singapur und Japan, ausgegeben werden oder ein Engagement in solchen Unternehmen ermöglichen.

Das Portfolio investiert in erster Linie in Unternehmen mit mittlerer und hoher Marktkapitalisierung.

Green Court Capital Management Limited, der Sub-Investment-Manager, wendet einen research-intensiven, fundamentalen Bottom-up-Ansatz an. Durch laufende Beurteilung der makroökonomischen Faktoren und Marktfaktoren wird die Einzeltitelauswahl verbessert. Der Anlageansatz ist diskretionär und berücksichtigt verschiedene Faktoren und Anlagestrategien über verschiedene Zeithorizonte.

Das Portfolio ist in erster Linie so aufgebaut, dass er über- und untergewichtete Positionen in der Markt-Benchmark MSCI China Index einght. Die Entscheidungen, ob die Positionen des Portfolios gegenüber der Benchmark unter- oder übergewichtet werden, werden in erster Linie auf Basis der Bewertung, der Bewertungsqualität und makroökonomischer Faktoren, einschließlich Variablen wie Wachstumschancen, Wettbewerbsvorteile und Risikomerkmale, über kurz-, mittel- und langfristige Anlagehorizonte getroffen, aber wo relevant, haben die Anforderungen der Zentralbank in Bezug auf Konzentrationsbeschränkungen, wie im Abschnitt „Anlagebeschränkungen“ im Verkaufsprospekt beschrieben, Vorrang vor diesen Faktoren.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### China Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse CHF I	31. Juli 2015	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	14. Juli 2009	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	14. Juli 2009	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	3. Juni 2014	EUR
Ausschüttende Klasse GBP A <sup>1</sup>	21. Mai 2015	GBP
Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>	1. Dezember 2014	SGD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	14. Juli 2009	USD
Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>	27. August 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I	14. Juli 2009	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	11. August 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD M	27. Mai 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD U	27. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. August 2014	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### CLO Income

Das Anlageziel des CLO Income (das „Portfolio“) ist es, eine attraktive Gesamtrendite (eine Kombination aus Kapitalzuwachs und laufenden Erträgen) zu erzielen, indem er hauptsächlich in Mezzanine-Schuldtitel in USD und EUR investiert, die auf variabel verzinsliche, besicherte Schuldtitel („CLO“) mit variablem Zinssatz lauten, sowie ebenfalls in US-amerikanische Hochzinsanleihen, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Das Portfolio strebt danach, sein Ziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, der darauf abzielt, CLO-Mezzanine-Schuldtitel zu identifizieren, die durch ein zugrunde liegendes Portfolio von Krediten mit einem höheren Portfolio-Score gesichert sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR A	9. Juni 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	12. Juli 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	15. November 2018	EUR
Ausschüttende Klasse GBP I2	15. November 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	12. Dezember 2019	GBP
Thesaurierende Klasse SEK I	12. Juli 2018	SEK
Thesaurierende Klasse USD A	9. Juni 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I	12. Juli 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	21. März 2019	USD
Ausschüttende Klasse USD I5	12. Juli 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	18. April 2019	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Commodities

Das Anlageziel des Commodities (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) durch Engagements in einer breiten Palette an Rohstoffen zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, wird das Portfolio Engagements in einer breiten Palette an Rohstoffgruppen anstreben, u. a. Energie, Edelmetalle, Industriemetalle, Lebewild, Agrarrohstoffe und Landwirtschaft.

Das Portfolio ist bestrebt, dieses Engagement durch eine Mischung von Anlagen zu erhalten, u. a. hauptsächlich Anlagen in rohstoffbezogene derivative Finanzinstrumente („FDI“) und Direktanlagen in die Aktien und aktienbezogenen Wertpapiere (nämlich Stamm- und Vorzugsaktien, ADRs und GDRs) von rohstoffabhängigen Unternehmen. Ferner kann das Portfolio ein Engagement in Rohstoffen anstreben, indem es in Anteile von Organismen für gemeinsame Anlagen investiert, u. a. börsengehandelte Fonds („ETFs“) und andere Teilfonds des Fonds, wenn diese Anlage ein Rohstoffengagement in Einklang mit der Anlagepolitik des Portfolios bietet.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	14. Dezember 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I5	29. März 2022	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	15. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I	9. Februar 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	4. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	14. April 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	15. Februar 2022	USD

### Corporate Hybrid Bond

Das Anlageziel des Corporate Hybrid Bond (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer attraktiven Gesamrendite (Ertrag zuzüglich Kapitalzuwachs).

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in hybride Unternehmensanleihen, die ein Rating von Investment Grade oder unter Investment Grade aufweisen. Das Portfolio strebt die Anwendung von Grundsätzen der fundamentalen Bottom-up-Analyse bei der Auswahl der Wertpapiere zur Anlage an, d. h. die Analysen, die Neuberger Berman Investment Advisers LLC (der „Sub-Investment-Manager“) durchführt, konzentrieren sich auf die Stärken der einzelnen Wertpapiere, anstatt Wertpapiere auf Basis breiterer Themen, wie etwa nach Branchen, auszuwählen. Die Analyse der Stärke eines Wertpapiers erfolgt individuell für jedes Wertpapier statt auf Basis breiterer Themen. So wird beispielsweise das Bonitätsrating des Wertpapiers im Verhältnis zu seiner erwarteten Rendite analysiert. Das Portfolio setzt den Schwerpunkt auf Wertpapiere, die weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, und ist nicht an Branchen oder Sektoren gebunden. Das Portfolio kann bei seinem Engagement zwischen geografischen Regionen und Ländern sowie zwischen Sektoren und Emittenten in Abhängigkeit von den wirtschaftlichen oder regionalen Fundamentaldaten (wie etwa der Bewertung der einzelnen Wertpapiere im Vergleich zu ähnlichen Wertpapieren) rotieren. Das Portfolio kann durch seine Anlagen in nachrangigen Schuldtiteln und/oder Wertpapieren mit Ratings unter Investment Grade ein mittleres Volatilitätsniveau aufweisen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	23. September 2016	AUD
Thesaurierende Klasse CHF P	27. April 2017	CHF
Ausschüttende Klasse CHF P	17. Juni 2016	CHF
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	18. Juli 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A	3. Juni 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	19. November 2015	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	19. November 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	3. Februar 2017	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	24. Dezember 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I3	13. September 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	19. November 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	13. Februar 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR P	27. April 2017	EUR
Ausschüttende Klasse EUR P	24. Juni 2016	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	9. März 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	15. Mai 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	24. August 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	16. August 2019	GBP
Ausschüttende Klasse GBP P	19. Mai 2017	GBP
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	2. August 2019	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	18. Juli 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD A	10. August 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD A	23. April 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	13. Dezember 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	14. Juni 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I	23. April 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	3. Februar 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	3. Februar 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD M	15. Dezember 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	15. Dezember 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	5. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	20. Januar 2017	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt – Hard Currency

Das Anlageziel des Emerging Market Debt – Hard Currency (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe risikobereinigte Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus auf Hartwährungen lautenden Schuldtiteln aus Schwellenländern zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von öffentlichen und privaten Emittenten in Schwellenländern emittiert werden und auf Hartwährungen lauten. Als „Hartwährungen“ im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>	26. Februar 2019	AUD
Ausschüttende Klasse AUD I	26. Mai 2020	AUD
Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	31. Oktober 2022	CAD
Thesaurierende Klasse CHF I2	13. Januar 2020	CHF
Thesaurierende Klasse CHF P	24. Januar 2018	CHF
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) <sup>1</sup>	16. April 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	31. Mai 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	31. Mai 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	17. September 2019	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	7. Oktober 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	18. Dezember 2019	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	6. November 2019	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I3	29. Juli 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	6. September 2019	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4	10. Dezember 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	5. Juli 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR P	23. Januar 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	29. Dezember 2017	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	16. Dezember 2016	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	21. Februar 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	26. Januar 2018	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	6. Juli 2015	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	14. März 2018	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup>	9. Januar 2019	HKD
Thesaurierende Klasse JPY I	11. Dezember 2017	JPY
Thesaurierende Klasse SEK A	5. November 2015	SEK
Thesaurierende Klasse SEK I2	19. Mai 2021	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>	17. Februar 2015	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	31. Mai 2013	USD



## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse USD A	30. Oktober 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	24. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	31. Mai 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	31. Mai 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	15. November 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	20. April 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD I3	20. März 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	15. September 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	11. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD X	16. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	26. April 2017	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Emerging Market Debt – Local Currency

Das Anlageziel des Emerging Market Debt – Local Currency (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe risikobereinigte Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus lokalen Währungen und lokalen Zinssätzen von Schwellenländern zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen und staatlichen Stellen in Schwellenländern oder von Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, emittiert werden und die auf die lokalen Währungen dieser Schwellenländer lauten oder dem Währungsrisiko dieser Währungen unterliegen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	4. Juni 2015	AUD
Thesaurierende Klasse AUD B	4. Juni 2015	AUD
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	4. Juni 2015	AUD
Thesaurierende Klasse AUD C2	4. Juni 2015	AUD
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	4. Juni 2015	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	4. Juni 2015	AUD
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	4. Juni 2015	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	4. Juni 2015	AUD
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	28. Juni 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	28. Juni 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	27. Juni 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	29. Dezember 2015	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	14. März 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)	25. Januar 2021	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	22. September 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	2. November 2016	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	2. November 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	25. Januar 2021	GBP

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse SEK A	5. November 2015	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>	4. März 2015	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	28. Juni 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	4. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD B	4. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	4. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	4. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	4. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD E	4. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	2. September 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I	28. Juni 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	14. Oktober 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	13. August 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	26. September 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31. März 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD T	4. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD X	23. Oktober 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD Y	14. Januar 2021	USD
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR B	5. Juni 2015	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	5. Juni 2015	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	5. Juni 2015	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	5. Juni 2015	ZAR

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt Blend

Das Anlageziel des Emerging Market Debt Blend (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamrendite aus einer Mischung aus auf Hartwährungen lautenden, in Schwellenländern emittierten Schuldtiteln, lokalen Währungen von Schwellenländern und Schuldtiteln von Unternehmen in Schwellenländern zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen und staatlichen Stellen in Schwellenländern oder von Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, emittiert werden und die auf die lokalen Währungen dieser Schwellenländer lauten oder dem Währungsrisiko dieser Währungen unterliegen oder auf Hartwährungen lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD I3	6. November 2019	AUD
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	4. Dezember 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	8. Juli 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	19. Juni 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	27. Mai 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	24. Februar 2015	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I3	5. November 2019	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	23. März 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	23. April 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	2. Juni 2014	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	31. März 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	12. April 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	22. Mai 2018	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22. Mai 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	13. Mai 2019	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	13. Mai 2019	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	17. März 2016	GBP
Thesaurierende Klasse NOK U	13. März 2017	NOK
Thesaurierende Klasse SEK A	5. November 2015	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>	15. September 2017	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	15. September 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	4. Februar 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	24. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	23. April 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I	1. Juni 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	24. Februar 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	20. Dezember 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	26. September 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	28. September 2015	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Das Anlageziel des Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (das „Portfolio“) ist es, eine ansprechende Gesamrendite aus einer Mischung aus auf Hartwährungen und Lokalwährungen lautenden Schuldtiteln mit Investment Grade zu erzielen, die von Regierungen, quasistaatlichen und staatsnahen Stellen und Unternehmen in Schwellenländern begeben wurden, die die im Abschnitt „Nachhaltige Anlagekriterien“ des Prospekts definiert sind (die „Nachhaltigkeitskriterien“).

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente mit Investment Grade, die von Regierungen und staatlichen Stellen in Schwellenländern oder von Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, emittiert werden und die auf die Währungen dieser Schwellenländer („lokale Währungen“) lauten oder dem Währungsrisiko dieser Währungen unterliegen oder auf Hartwährungen lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro, britisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse AUD I2	16. Februar 2021	AUD
Thesaurierende Klasse NOK I	9. Mai 2018	NOK
Thesaurierende Klasse USD I	10. Juli 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	16. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	2. November 2017	USD

### Emerging Markets Equity

Das Anlageziel des Emerging Markets Equity (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung von langfristigem Kapitalzuwachs. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Dividendenpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere weltweit, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen ausgegeben werden, die:

- überwiegend an einer anerkannten Börse in Schwellenländern gehandelt werden;
- nach den Gesetzen von Schwellenländern organisiert sind und ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben; oder
- deren Gesamtumsatz und/oder Gesamtvermögen zu mindestens 50 % aus in Schwellenländern hergestellten Waren, erzielten Umsätzen oder Gewinnen oder Dienstleistungen stammen. Das Portfolio kann auch in andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die ein Engagement in solchen Wertpapieren ermöglichen, allerdings nur bis zu maximal 10 % des Nettoinventarwerts des Portfolios.

Neuberger Berman Investment Advisers LLC (der „Sub-Investment Manager“) wendet bei der Auswahl der Wertpapiere einen fundamentalen, research-intensiven Bottom-up-Ansatz an und setzt den Schwerpunkt auf Unternehmen mit hohen Renditen. Hierbei werden wirtschaftliche, gesetzliche und geschäftliche Entwicklungen berücksichtigt, um Länder und Wirtschaftssektoren (wie Energie, Finanzen, Gesundheitswesen, Telekommunikationsdienstleistungen und Versorger) zu identifizieren, die seiner Einschätzung nach besonders attraktiv sind.

Der Sub-Investment-Manager ist bestrebt, in Unternehmen zu investieren, von denen er glaubt, dass sie über nachhaltiges Wachstum des freien Cashflows verfügen und zu attraktiven Bewertungen gehandelt werden. Mit dem so konstruierten Portfolio soll das Risiko verringert werden, indem es über viele Branchen innerhalb der von ihm identifizierten Länder und Wirtschaftssektoren diversifiziert, wobei generell beabsichtigt ist, über Länder und geografische Regionen hinweg diversifiziert zu bleiben.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse AUD B	30. November 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD C2	30. November 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	30. November 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	30. November 2016	AUD
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	24. Januar 2018	CAD
Ausschüttende Klasse CAD I2	17. Dezember 2021	CAD
Thesaurierende Klasse EUR I	4. Oktober 2010	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	5. Februar 2018	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	15. Januar 2014	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	17. März 2016	GBP
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	4. Oktober 2010	USD
Thesaurierende Klasse USD B	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD E	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I	4. Oktober 2010	USD
Thesaurierende Klasse USD M	27. Mai 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD T	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	30. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse ZAR B	30. November 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	30. November 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	30. November 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	30. November 2016	ZAR

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Emerging Markets Select Equity

Das Anlageziel des Emerging Markets Select Equity (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung von langfristigem Kapitalzuwachs, überwiegend durch die Anlage in Schwellenländerunternehmen.

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Dividendenpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere weltweit, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen ausgegeben werden, die: (1) hauptsächlich an einer anerkannten Börse in Schwellenländern handeln; (2) nach dem Recht eines Schwellenlandes gegründet wurden und dort einen Hauptsitz haben; oder (3) 50 % oder mehr ihres Gesamtumsatzes aus Schwellenländern, und/oder 50 % oder mehr ihrer Gesamtaktiva aus dort hergestellten Waren, getätigten Verkäufen, erzeugten Gewinnen oder erbrachten Dienstleistungen beziehen. Das Portfolio kann auch in andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die ein Engagement in solchen Wertpapieren ermöglichen, allerdings nur bis zu maximal 10 % des Nettoinventarwerts des Portfolios. Das Portfolio kann sich über Participatory Notes in einem Land oder einer Region der Schwellenmärkte durch Anlagen in Wertpapieren engagieren, die an Börsen oder Märkten in einem anderen Land gehandelt werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	8. Januar 2020	EUR
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	3. Dezember 2018	JPY
Thesaurierende Klasse USD I	24. Oktober 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	22. November 2017	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Euro Bond Absolute Return

Das Anlageziel des Euro Bond Absolute Return (das „Portfolio“) ist es, über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3-5 Jahre) unabhängig von Marktbedingungen und mit moderater Volatilität positive absolute Renditen zu erzielen. Dies soll durch die Umsetzung einer uneingeschränkten Strategie erreicht werden, die Long- und synthetische Short-Positionen in einem diversifizierten Portfolio von überwiegend in Euro denominierten Schuldtiteln kombiniert.

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, bei dem eine Kombination aus Top-down und Bottom-up-Strategien zur Identifizierung vielfacher Wertquellen eingesetzt wird. Top-down-Strategien konzentrieren sich auf makroökonomische Aspekte sowie Länder- und Sektoranalysen. Bottom-up-Strategien bewerten die Eigenschaften einzelner Instrumente oder Emittenten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I	29. November 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	29. November 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	28. März 2019	EUR
Thesaurierende Klasse USD Z	22. November 2019	USD

### Euro Opportunistic Bond

Das Anlageziel des Euro Opportunistic Bond (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer attraktiven Gesamrendite (Ertrag und Kapitalzuwachs), indem er in einen diversifizierten Mix aus fest- und variabel verzinslichen, in Euro denominierten Schuldtiteln investiert.

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, der in auf Euro lautende Anleihen über eine Vielzahl von Sektoren und Laufzeiten hinweg investiert und dabei eine Kombination aus Top-down- und Bottom-up-Strategien zur Identifizierung einer Vielzahl an Wertquellen einsetzt. Top-down-Strategien konzentrieren sich auf makroökonomische Aspekte sowie Länder- und Sektoranalysen. Bottom-up-Strategien bewerten die Eigenschaften einzelner Instrumente oder Emittenten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I	14. November 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	14. November 2018	EUR

### European High Yield Bond

Das Anlageziel des European High Yield Bond (das „Portfolio“) ist es, am europäischen Markt für hochverzinsliche Festzinsanlagen eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in fest verzinsliche Hochzins-Unternehmensanleihen, die (i) auf eine europäische Währung lauten oder (ii) von Unternehmen jeder Branche emittiert oder garantiert werden, die ihren Hauptsitz in einem europäischen Land haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in einem europäischen Land ausüben und an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I	27. Juni 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	20. Februar 2018	EUR
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I	27. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD X	12. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	26. April 2019	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### European Sustainable Equity

Anlageziel des European Sustainable Equity (das „Portfolio“) ist es, über einen Anlagehorizont von 3 bis 5 Jahren eine jährliche Überschussrendite von mindestens 2 % gegenüber der Benchmark (dem MSCI Europe Index (Total Return, Net of Tax, EUR)) vor Gebühren zu erzielen, indem hauptsächlich in ein Portfolio aus europäischen Aktienbeständen investiert wird, die den Nachhaltigkeitskriterien (wie im Prospekt dargelegt) Rechnung tragen.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über den Anlagehorizont noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb des Anlagehorizonts erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	Auflegungsdatum der Anteilklasse	Währung
Ausschüttende Klasse EUR A <sup>1</sup>	12. Januar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	24. Februar 2021	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	24. Februar 2021	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I3	7. Oktober 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	20. Juli 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	24. Februar 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	29. März 2021	EUR
Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	15. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	15. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	15. März 2021	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Event Driven

Das Anlageziel des Event Driven (das „Portfolio“) ist es, durch den Einsatz von Event-Driven-Strategien (Ereignisorientierte Strategien) positive, marktneutrale und risikobereinigte absolute Renditen mit geringer Korrelation zu breiteren Aktienmärkten zu generieren.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es sowohl Long-Positionen als auch synthetische Short-Positionen in globalen Dividendenpapieren durch die Nutzung von Event-Driven-Strategien eingeht. Event-Driven-Strategien basieren auf angekündigten oder erwarteten Ereignissen oder einer Reihe von Ereignissen und auf Anlagen in die Wertpapiere von Unternehmen, auf die sich das Eintreten dieser Ereignisse auswirken könnte. Das Portfolio geht Engagements in Dividendenpapieren ein, die an anerkannten Märkten in Industrieländern notiert oder gehandelt werden, und die Kapitalmaßnahmen unterliegen oder voraussichtlich unterliegen werden, insbesondere Fusionen, Übernahmeofferten, Tauschangebote, Übernahmeangebote, Ausgliederungen, Stellvertreter-Kämpfe, Liquidationen, Kapitalaufstockungen, Unternehmensumstrukturierungen, Rechtsstreitigkeiten, gesetzliche oder aufsichtsrechtliche Ereignisse oder nachkonkursliche Situationen. Das Portfolio geht Long-Positionen in Bezug auf Dividendenpapiere ein, bei denen es mit einem Wertanstieg infolge dieser Ereignisse rechnet, und geht synthetische Short-Positionen in Dividendenpapieren ein, bei denen es infolge dieser Ereignisse einen Wertrückgang erwartet.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	Auflegungsdatum der Anteilklasse	Währung
Thesaurierende Klasse GBP I5	26. Oktober 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I5	26. Oktober 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	26. Oktober 2022	GBP
Thesaurierende Klasse USD I	26. Oktober 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	26. Oktober 2022	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Bond

Das Anlageziel des **Global Bond** (das „Portfolio“) ist es, an den weltweiten Rentenmärkten eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio in erster Linie in:

- Schuldtitle mit Investment-Grade-Rating, die von Regierungen und Behörden der Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung („OECD“) begeben werden; und
- Schuldtitle mit Investment-Grade-Rating, die von Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in OECD-Ländern haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben.

Alle Wertpapiere werden an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt.

Der Anlage-Ansatz basiert auf vier grundlegenden differenzierenden Faktoren:

- Diversifizierung durch den Einsatz verschiedener, nicht korrelierender Alpha-Quellen
- Aktives Währungsmanagement
- Integriertes Global Macro Overlay
- Hauseigene Risikomanagementsysteme

Darüber hinaus führen der Manager und Sub-Investment-Manager Datenanalysen durch und versuchen, Chancen über verschiedene Zeithorizonte zu nutzen. Kern der Anlagephilosophie sind die qualitativen Beurteilungen des Managers und Sub-Investment-Managers, die in allen Phasen des Anlageprozesses durchgeführt werden. Dieser Ermessensspielraum gibt dem Investment-Manager die Möglichkeit, Informationen und Ereignisse zu berücksichtigen, die nicht ohne weiteres quantifiziert werden können, so zum Beispiel politische Ereignisse, Veränderungen der regulatorischen Rahmenbedingungen oder die Wirkung von Marktpositionierung und Absicherung.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	3. Februar 2021	AUD
Thesaurierende Klasse USD C1	3. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	26. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I	16. Juli 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD M	2. Juli 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	3. Februar 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	20. Januar 2017	USD
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	3. Februar 2021	ZAR

### Global Diversified Income FMP – 2024

Das Anlageziel des **Global Diversified Income FMP - 2024** (das „Portfolio“) ist die Maximierung der laufenden Erträge während der Laufzeit des Portfolios, indem in eine diversifizierte Mischung aus globalen festverzinslichen Wertpapieren, einschließlich hochverzinslicher Wertpapiere, investiert wird.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente investiert, unter anderem durch den Einsatz von FDI, die von Regierungen, staatlichen Stellen und Unternehmen weltweit, auch innerhalb der Schwellenländer, begeben werden. Die Wertpapiere werden typischerweise weltweit an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt. Die Wertpapiere können von einer Anerkannten Ratingagentur mit Investment Grade oder niedriger bewertet sein.



## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR A	7. Juli 2020	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A	10. Juli 2020	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	29. Juli 2020	EUR
Ausschüttende Klasse GBP I	22. Juni 2020	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A	28. Juli 2020	HKD
Ausschüttende Klasse SGD A	22. Juni 2020	SGD
Thesaurierende Klasse USD A	22. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD A	22. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I	22. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I	22. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD X	22. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD X	22. Juni 2020	USD

### Global Equity Megatrends

Das Anlageziel des Global Equity Megatrends (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung von langfristigem Kapitalzuwachs, überwiegend durch die Anlage in ein Portfolio aus Aktienpositionen, die langfristigen globalen Themen ausgesetzt sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	19. Oktober 2018	EUR
Thesaurierende Klasse USD A	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD I	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD M	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	25. Februar 2022	USD

### Global Flexible Credit Income

Das Anlageziel des Global Flexible Credit Income (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamrendite aus einem hohen laufenden Ertrag und langfristigem Kapitalzuwachs zu erzielen, indem er in eine diversifizierte Mischung aus fest- und variabel verzinslichen globalen Schuldtiteln einschließlich Hochzinstiteln investiert.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel in erster Linie durch Anlagen in Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten zu erreichen, unter anderem durch den Einsatz von FDI, die von Regierungen, staatlichen Stellen sowie von Unternehmen weltweit, auch innerhalb der Schwellenländer, begeben werden. Die Wertpapiere werden typischerweise weltweit an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt. Die Wertpapiere können von einer Anerkannten Ratingagentur mit Investment Grade oder niedriger bewertet sein.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse CAD I5	18. März 2021	CAD
Thesaurierende Klasse EUR I	29. September 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	13. August 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I5	1. Juni 2020	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	16. September 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I	1. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I	1. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD M	16. September 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. Juni 2020	USD

### Global High Yield SDG Engagement

Das Anlageziel des Global High Yield SDG Engagement (das „Portfolio“) ist es, am globalen Markt für hochverzinsliche Festzinsanlagen eine möglichst hohe Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in:

- auf US-Dollar und andere Währungen lautende hochverzinsliche Festzinspapiere, die von Unternehmen einer beliebigen Branche emittiert oder garantiert werden; und
- hochverzinsliche Festzinspapiere mit kurzer Duration, die von Regierungen und staatlichen Stellen weltweit emittiert werden und vorwiegend auf US-Dollar lauten, die weltweit ansässig sind und an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden.

Das Portfolio investiert vorwiegend in Wertpapiere, die auf im BofA Merrill Lynch Global High Yield Constrained Index (in USD abgesicherte Gesamtrendite) enthaltene Währungen lauten.

Darüber hinaus kann das Portfolio auch in Wertpapiere von Unternehmen investieren, die ihren Sitz in Schwellenländern haben sowie in staatliche Wertpapiere von Schwellenländern, was im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Ländern mit einem zusätzlichen Risiko verbunden sein kann.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD I	3. Mai 2022	AUD
Thesaurierende Klasse CHF I4	3. Mai 2022	CHF
Ausschüttende Klasse CHF I4	3. Mai 2022	CHF
Thesaurierende Klasse CHF X	3. Mai 2022	CHF
Thesaurierende Klasse EUR I4	3. Mai 2022	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I4	3. Mai 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	3. Mai 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	4. August 2016	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I4	3. Mai 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP X	3. Mai 2022	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	16. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I	4. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I4	3. Mai 2022	USD
Ausschüttende Klasse USD M	29. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD X	10. November 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	4. August 2016	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global High Yield Sustainable Action

Das Anlageziel des Global High Yield Sustainable Action (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer Gesamrendite (Ertrag und Kapitalzuwachs) mit einem Schwerpunkt auf laufende Erträgen durch die Anlage in ein aktiv verwaltetes Portfolio aus globalen hochverzinslichen Festzinsanlagen, die die Nachhaltigkeitskriterien erfüllen.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es in Anleihen und andere übertragbare festverzinsliche Schuldtitel investiert, die die Nachhaltigkeitskriterien erfüllen und ein Rating ohne Investment Grade aufweisen. Die Emittenten dieser Wertpapiere können in jedem Land, auch in Schwellenländern, ansässig sein und eine Vielzahl von Industriesektoren und Laufzeiten abdecken.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse USD I	21. Januar 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I	21. Januar 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD X	10. November 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD Y	25. Februar 2021	USD

### Global Investment Grade Credit

Das Anlageziel des Global Investment Grade Credit (das „Portfolio“) besteht darin, vor Gebühren über einen Marktzyklus (von in der Regel 3 Jahren) eine durchschnittliche Zielrendite von 1% über der Benchmark (Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged USD)) zu erzielen. Zu diesem Zweck wird überwiegend in globale Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating investiert.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über einen Marktzyklus noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb eines Marktzyklus erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

Das Portfolio wird überwiegend in festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating investieren, die von Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in OECD-Ländern haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben. Das Portfolio strebt die Anwendung von Grundsätzen der fundamentalen Bottom-up-Analyse bei der Auswahl der Wertpapiere zur Anlage an, d. h. die Analysen des Managers und des Sub-Investment-Managers konzentrieren sich auf die Stärken der einzelnen Wertpapiere, anstatt Wertpapiere auf Basis breiterer Themen, wie etwa nach Branchen, auszuwählen. So wird das Rating des Wertpapiers im Verhältnis zur vorgeschlagenen Rendite analysiert, und die Merkmale des Wertpapiers werden unter die Lupe genommen, um die Vorhersagbarkeit von Cashflows zu bestimmen. Hierzu werden Faktoren wie das Cashflow-Profil des Emittenten, die Verschuldung und der Verschuldungsgrad herangezogen. Das Portfolio wird den Schwerpunkt auf Wertpapiere legen, die weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, und ist nicht an Branchen oder Sektoren gebunden. Das Portfolio kann bei seinem Engagement zwischen geografischen Regionen und Ländern sowie zwischen Sektoren und Emittenten in Abhängigkeit von den wirtschaftlichen oder regionalen Fundamentaldaten (wie etwa der Bewertung der einzelnen Wertpapiere im Vergleich zu ähnlichen Wertpapieren) rotieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse USD I	1. September 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD X	1. September 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. September 2021	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Opportunistic Bond

Das Anlageziel des Global Opportunistic Bond (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer attraktiven Gesamrendite (Ertrag und Kapitalzuwachs), indem er opportunistisch in einen diversifizierten Mix aus fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln in allen Sektoren und unter unterschiedlichen Marktbedingungen investiert.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in festverzinsliche Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen, staatlichen Stellen und Unternehmen weltweit emittiert werden. Die Wertpapiere werden weltweit an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt. Die Wertpapiere können von einer Anerkannten Ratingagentur mit Investment Grade oder niedriger bewertet sein. Ergänzend kann das Portfolio auch Vorzugsaktien von öffentlichen Emittenten oder Unternehmen halten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I	27. November 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP P	16. Januar 2020	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	22. September 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	20. Dezember 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I	20. Dezember 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	23. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	16. Mai 2019	USD

### Global Real Estate Securities

Das Anlageziel des Global Real Estate Securities (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer Gesamrendite (Total Return) insbesondere durch Kapitalzuwachs sowie aus laufenden Erträgen durch Anlagen in Wertpapieren von weltweit ansässigen Immobilienunternehmen.

Um sein Anlageziel zu erreichen, investiert das Portfolio mindestens 80 % seines Nettovermögens in Aktien aus den USA und anderen Ländern, die von Immobilienaktiengesellschaften (Real Estate Investment Trusts – „REITs“) emittiert werden, sowie in Stammaktien und andere Wertpapiere, die von anderen Immobilienunternehmen emittiert werden. Ein REIT ist ein Unternehmen, das Ertrag generierende Immobilien besitzt und in der Regel auch betreibt oder Immobilien finanziert. Das Portfolio definiert ein Immobilienunternehmen als ein Unternehmen, das mindestens 50 % seines Umsatzes aus Immobilien erzielt oder dessen Vermögen zu mindestens 50 % aus Immobilien besteht. Das Portfolio verteilt seine Vermögenswerte auf verschiedene Regionen und Länder, einschließlich der USA, ist aber stets in mindestens drei verschiedenen Ländern investiert. Das Portfolio kann auch bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in Aktien von Immobilienunternehmen mit Sitz in Schwellenländern investieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse EUR I5	8. Juli 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	4. November 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP Z	17. März 2016	GBP
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	9. Mai 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD CI	8. Januar 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I	30. Dezember 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I5	20. Dezember 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD M	2. Oktober 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	13. Februar 2015	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Sustainable Equity

Das Anlageziel des Global Sustainable Equity (das „Portfolio“) ist es, über einen Anlagehorizont von 3 bis 5 Jahren eine jährliche Überschussrendite von mindestens 2 % gegenüber der Benchmark (dem MSCI World Index (Total Return, Net of Tax, USD)) vor Gebühren zu erzielen, indem hauptsächlich in ein Portfolio aus globalen Aktienbeständen investiert wird, welche die Nachhaltigkeitskriterien (wie im Prospekt dargelegt) erfüllen.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über den Anlagehorizont noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb des Anlagehorizonts erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

Um dieses Ziel zu erreichen, wird das Portfolio vorwiegend in Aktien investieren, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden. Das Portfolio wird in erster Linie in Aktien von Unternehmen investieren, deren Verhaltensweisen, Prozesse und Geschäftstätigkeiten Fortschritte auf Systemebene zur Erlangung ökologischer und sozialer Ziele bewirken, wie z. B. durch: Zugang zur Gesundheitsversorgung, nachhaltigen Konsum (d. h. die Nutzung von Produkten, Energie und Dienstleistungen mit möglichst geringen Umweltauswirkungen) sowie bewusste Verbraucher, Zugang zu Informationen und digitale Revolution, Energiewende und industrielle Innovation, Ressourceneffizienz, Entwicklung des Humankapitals, Fintech und finanzielle Inklusion (d. h. die Verfügbarkeit von Finanzdienstleistungen und Chancengleichheit beim Zugang zu derlei Dienstleistungen). Um das Anlageziel des Portfolios zu erreichen, investiert der Sub-Investment-Manager in qualitativ hochwertige Unternehmen, die (i) attraktive nachhaltige Produkte oder Dienstleistungen anbieten, (ii) bei ihrer Geschäftstätigkeit eine Verpflichtung zu Nachhaltigkeit unter Beweis stellen und (iii) wirtschaftlich wettbewerbsfähig sind, wie nachstehend detaillierter erläutert. Der Sub-Investment-Manager beabsichtigt, einen Anlageprozess zu verfolgen, der sich auf die Analyse von „Best-in-Class“-Unternehmen innerhalb eines Anlageuniversums von börsennotierten Aktien erstreckt, die von Unternehmen hauptsächlich aus Industrieländern weltweit begeben werden, und zwar sowohl in finanzieller als auch in ESG-Hinsicht (Umwelt, Soziales, Governance). Die Finanz- und ESG-Analysen werden es dem Sub-Investment-Manager ermöglichen, Unternehmen zu bewerten und identifizieren, die im Hinblick auf ihre Performance bei finanziellen und ESG-Faktoren als „Best-in-Class“ erachtet werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	24. Februar 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	24. Februar 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	31. März 2021	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	6. April 2021	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	6. April 2021	GBP
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	2. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I	24. Februar 2021	USD
Ausschüttende Klasse USD I	24. Februar 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD M	15. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	25. Februar 2022	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### High Yield Bond

Das Anlageziel des High Yield Bond (das „Portfolio“) ist es, am Markt für hochverzinsliche Festzinsanlagen eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio in erster Linie in:

- hochverzinsliche Festzinsanlagen, die von Unternehmen in den USA und außerhalb der USA emittiert werden, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben, sowie
- hochverzinsliche Festzinsanlagen, die von Regierungen und staatlichen Stellen in den USA emittiert werden und überwiegend auf US-Dollar lauten.

Diese Anlagen werden an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt. Darüber hinaus kann das Portfolio, obwohl es seine Anlagen auf die USA konzentriert, auch in Wertpapiere von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern sowie in Wertpapiere von Regierungen von Schwellenländern investieren. Dies kann im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Volkswirtschaften mit zusätzlichen Risiken verbunden sein.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>	5. September 2012	AUD
Thesaurierende Klasse AUD A <sup>1</sup>	28. August 2012	AUD
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	22. Juli 2013	AUD
Thesaurierende Klasse AUD B	10. Dezember 2020	AUD
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	19. Juli 2013	AUD
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	2. Juli 2014	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	2. Juli 2014	AUD
Ausschüttende Klasse AUD I	29. Dezember 2011	AUD
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	27. Juni 2013	AUD
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	11. Juni 2013	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	2. August 2013	AUD
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) <sup>1</sup>	23. Juli 2013	CAD
Thesaurierende Klasse CHF A	5. Juli 2011	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I	27. Mai 2011	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I2	22. Oktober 2013	CHF
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1. August 2012	CNY
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	9. November 2012	CNY
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) <sup>1</sup>	19. Juni 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	3. Mai 2006	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A <sup>1</sup>	24. Februar 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	9. November 2009	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	18. Oktober 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	5. Dezember 2012	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	5. Dezember 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	5. November 2014	EUR
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) <sup>1</sup>	7. Juli 2014	GBP
Thesaurierende Klasse GBP A <sup>1</sup>	27. April 2011	GBP
Ausschüttende Klasse GBP A <sup>1</sup>	24. Februar 2012	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I	27. Juli 2010	GBP

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### High Yield Bond (Fortsetzung)

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse GBP I	8. November 2006	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	17. März 2016	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup>	14. September 2012	HKD
Thesaurierende Klasse SEK A	16. Juni 2011	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>	30. März 2012	SGD
Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>	9. März 2012	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	2. Mai 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) <sup>1</sup>	22. Januar 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	11. Januar 2010	USD
Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>	24. Februar 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	31. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD B	31. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C	21. November 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	25. Oktober 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD C1	7. September 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	31. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	31. Oktober 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	2. Juli 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD E	2. Juli 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	13. September 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD I	3. Mai 2006	USD
Ausschüttende Klasse USD I	16. November 2009	USD
Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	24. September 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	1. Juni 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD M	1. März 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD P	9. Januar 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31. Oktober 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	11. Juni 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD T	31. Oktober 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	2. Mai 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD U	9. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	2. Mai 2014	USD
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	2. Juli 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	2. Juli 2014	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	19. Dezember 2016	ZAR

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### InnovAsia 5G

Das Anlageziel des InnovAsia 5G (das „Portfolio“) ist es, überwiegend in ein Portfolio von Aktienbeständen zu investieren, dessen Schwerpunkt auf Unternehmen liegt, die an innovativen Technologien (wie nachstehend definiert) beteiligt sind oder davon profitieren.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen mit innovativen Technologien oder Geschäftsmodellen emittiert werden, die:

- gemäß den Gesetzen eines asiatischen Landes gegründet oder organisiert sind oder ihren Hauptsitz in Asien haben;
- im Allgemeinen einen Großteil ihres zusätzlichen Wachstums aus (a) Waren, die im Großraum China hergestellt oder verkauft werden, (b) Investments, die im Großraum China getätigt werden, oder (c) Dienstleistungen, die in Asien erbracht werden, generieren, oder
- im Allgemeinen eine Mehrheit ihrer Vermögenswerte in Asien halten.

Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

Zur Realisierung des Anlageziels auf Portfolioebene verfolgen die Sub-Investment-Manager den folgenden Anlageprozess (der nachstehend ausführlicher beschrieben wird), um ein Universum von Unternehmen zu identifizieren, die auf lange Sicht ein Engagement in bahnbrechenden Technologien, innovativen Geschäftsmodellen mit einer relativ niedrigen Durchdringungsrate in Asien oder in einer relativ frühen Wachstumsphase sowie strukturellen Trends und Themen wie 5G/Internet der Dinge (unter anderem Dateninfrastruktur, vernetzte Geräte oder fortschrittliche Halbleiter), digitaler Lebensstil (unter anderem Gesundheitswesen, Bildung oder Internet und Verbraucher) und industrielle Innovationen (unter anderem Robotik, saubere Technologien oder intelligente Logistik) („Innovative Technologien“) bieten:

- Qualitative Unternehmensanalysen – zur Identifizierung von Unternehmen, die eine Schlüsselposition bei der Einführung innovativer Technologien einnehmen, sowie von Unternehmen, die gut aufgestellt sind, um von neuen Geschäftsmodellen in Verbindung mit innovativen Technologien zu profitieren;
- Quantitative Filter – zur Identifizierung von Unternehmen, die von den Sub-Investment-Managern als unter Umständen zu illiquide oder von zu geringer Marktkapitalisierung erachtet werden;
- Strategische Bewertung und Analyse – zur eingehenden Untersuchung und Analyse von Unternehmen, einschließlich der Unternehmens-/Geschäftsmodelle, der Qualität der Geschäftsleitung, der Wettbewerbsfähigkeit und der Erfolgsbilanz, ermittelt auf Basis vorhandener Finanzdaten (z. B. Daten über Marktanteile); und
- Wertpapierauswahl und Portfoliokonstruktion – zur Auswahl von Unternehmen, die über die erforderlichen Fähigkeiten verfügen, um die Entwicklung innovativer Technologien zu fördern, und von denen die Sub-Investment-Manager der Meinung sind, dass sie über einen Zeitraum von drei bis fünf Jahren ein erhebliches Potenzial zur Steigerung ihres Kapitalwerts aufweisen, sowie zur Bestimmung von Kurszielen auf der Grundlage der aktuellen Marktpreise der Wertpapiere und vorangegangener Analysen, um Anhaltspunkte für Kauf- und Verkaufsentscheidungen zu erhalten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse CHF I4	14. Juli 2021	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A	14. Juli 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4	14. Juli 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	18. Oktober 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	14. Juli 2021	EUR
Thesaurierende Klasse SGD A	14. Juli 2021	SGD
Thesaurierende Klasse SGD I4	14. Juli 2021	SGD
Thesaurierende Klasse SGD X	14. Juli 2021	SGD
Thesaurierende Klasse USD A	14. Juli 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I	14. Juli 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I4	14. Juli 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD M	5. November 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD X	14. Juli 2021	USD



## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Japan Equity Engagement

Das Anlageziel des Japan Equity Engagement (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung einer durchschnittlichen Zielrendite von 3 % über der des MSCI Japan Small Cap Net Index über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3 Jahre).

Um sein Anlageziel zu erreichen, wird das Portfolio in Aktien von Unternehmen mit kleiner und mittlerer Marktkapitalisierung investieren, die ihren Hauptsitz entweder in Japan haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Japan ausüben und weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse EUR I5	10. Februar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I5	22. September 2021	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	11. November 2021	GBP
Thesaurierende Klasse JPY I	12. Mai 2020	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	12. Mai 2020	JPY
Thesaurierende Klasse JPY I5	16. Februar 2021	JPY
Thesaurierende Klasse JPY Z	28. April 2021	JPY

### Macro Opportunities FX

Das Anlageziel des Macro Opportunities FX (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung einer durchschnittlichen Zielrendite von 5-6 % über dem Geldmarkt vor Gebühren über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3 Jahre).

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel zu erreichen, indem es:

- als Erstes Long- und Short-Engagements in einer Reihe globaler liquider Währungen eingeht, vorwiegend – aber nicht darauf beschränkt – in G10-Währungen und opportunistisch in den liquidesten Schwellenländerwährungen (dies sind für gewöhnlich die am stärksten gehandelten Währungen, z. B. der brasilianische Real, der Singapur-Dollar und der südkoreanische Won) mittels einer Auswahl derivativer Finanzinstrumente; und
- Zweitens, durch Anlagen in weltweiten festverzinslichen Schuldtiteln und kurzfristigen, auf Euro lautenden Anleihen, um opportunistisch die Barrenditen zu steigern und um für Liquidität und Sicherheitendeckung für Engagements zu sorgen, die durch den Einsatz derivativer Finanzinstrumente (wie weiter oben beschrieben) entstanden sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I	4. Dezember 2019	EUR
Thesaurierende Klasse GBP Z	4. Dezember 2019	GBP
Thesaurierende Klasse SEK I	11. Dezember 2019	SEK
Ausschüttende Klasse SEK I	20. Oktober 2021	SEK
Thesaurierende Klasse USD I	4. Dezember 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	4. Dezember 2019	USD

### Multi-Asset Income

Das Anlageziel des Multi-Asset Income (das „Portfolio“) ist die Erzielung von Ertrag und Kapitalzuwachs.

Um dieses Ziel zu erreichen, verteilt das Portfolio seine Vermögenswerte vorwiegend auf mehrere Anlageklassen. Er investiert in Strategien, die durch globale Aktien und Schuldtitel, Währungen und OGAW-fähige Engagements in Rohstoffen Erträge für das Portfolio generieren sollen. Das Portfolio kann ein Engagement in diesen Anlageklassen über direkte Anlagen in diesen Wertpapieren (außer im Fall von Rohstoffen), Anlagen in börsengehandelte Schuldtitel und Zertifikate oder andere geeignete Organismen für gemeinsame Anlagen („Basisfonds“), einschließlich börsengehandelter Fonds („ETFs“), die selbst in diesen Anlagen engagiert sind, oder durch den Einsatz von FDI erhalten. Das Engagement in Rohstoffen wird über ein Engagement in Rohstoffindizes erreicht, die vorher von der Zentralbank zur Nutzung durch OGAW freigegeben wurden.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse GBP P	27. Februar 2020	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	28. Februar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	1. März 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD I	28. Dezember 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I	28. Dezember 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD M	9. August 2017	USD

### Next Generation Mobility

Das Anlageziel des Next Generation Mobility (das „Portfolio“) ist es, einen langfristigen Kapitalzuwachs durch die vorrangige Anlage in ein Portfolio globaler Beteiligungen zu erzielen, wobei der Schwerpunkt auf Unternehmen liegt, die an der Mobilität für die nächste Generation beteiligt sind oder davon profitieren.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden. Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	7. September 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	13. Januar 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	24. Juni 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	26. Oktober 2018	EUR
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	11. September 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	21. Mai 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD I	21. August 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD I	21. August 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD M	21. Mai 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD X	23. Januar 2019	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Next Generation Space Economy

Das Anlageziel des Next Generation Space Economy (das „Portfolio“) ist es, einen langfristigen Kapitalzuwachs durch die vorrangige Anlage in ein Portfolio globaler Aktienpositionen zu erzielen, die an der Weltraumwirtschaft der nächsten Generation beteiligt sind oder davon profitieren.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden. Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Next Generation Space Economy (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	10. Mai 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	10. Mai 2022	EUR
Thesaurierende Klasse USD I	10. Mai 2022	USD

### Short Duration Emerging Market Debt

Das Anlageziel des Short Duration Emerging Market Debt (das „Portfolio“) ist es, einen stabilen Ertrag und eine stabile Rendite zu erzielen, indem er in eine diversifizierte Auswahl an auf Hartwährungen lautenden Staats- und Unternehmensanleihen mit kurzer Duration investiert, die in Schwellenländern emittiert werden. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro, britisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente mit kurzer Duration, die von öffentlichen Emittenten oder Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, und die auf Hartwährungen lauten. Anleger sollten auch beachten, dass Unternehmen, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind, als öffentliche Emittenten betrachtet werden. Mit Ausnahme zulässiger Anlagen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, die nicht börsennotiert sind, werden alle Wertpapiere, in die das Portfolio investiert, an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen oder Regionen gesetzt.

Anlagen in Wertpapieren, die von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern sowie von Regierungen und staatlichen Stellen von Schwellenländern emittiert werden, können im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Ländern zusätzlichen Risiken unterliegen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. August 2016	AUD
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) <sup>1</sup>	6. November 2015	CAD
Thesaurierende Klasse CHF A	6. Juni 2014	CHF
Ausschüttende Klasse CHF A	6. Juni 2014	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I	6. Juni 2014	CHF
Ausschüttende Klasse CHF I	13. Juni 2014	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I2	20. Februar 2015	CHF
Ausschüttende Klasse CHF I2	18. April 2017	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I5	31. März 2014	CHF
Thesaurierende Klasse CHF P	25. April 2017	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	13. Juni 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A	6. Juni 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	6. Juni 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	6. Juni 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	23. Juni 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	30. März 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	14. März 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR P	23. Februar 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR U	6. Juni 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR X	16. März 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP A <sup>1</sup>	22. November 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I	16. Dezember 2016	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	20. Februar 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	30. September 2016	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	19. Oktober 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I5	11. April 2014	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	13. August 2019	GBP
Thesaurierende Klasse JPY I	23. Februar 2015	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	22. September 2014	JPY
Thesaurierende Klasse SEK A	2. Februar 2018	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	6. Dezember 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD A	6. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	29. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD C1	29. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	31. Oktober 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	2. Juni 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	12. September 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	30. Oktober 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	19. März 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I5	9. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD M	24. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	29. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	10. August 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. April 2014	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Short Duration High Yield SDG Engagement

Der Short Duration High Yield SDG Engagement (das „Portfolio“) strebt als Anlageziel einen hohen laufenden Ertrag durch Anlage in hochverzinslichen Festzinsanlagen mit kurzer Duration an.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Hochzinsanleihen mit kurzer Duration, die emittiert werden von:

- Unternehmen in den USA und außerhalb der USA, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben; und
- Regierungen und staatlichen Stellen in den USA, die überwiegend auf US-Dollar lauten und an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden. Es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Darüber hinaus kann das Portfolio, obwohl es seine Anlagen auf die USA und andere Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung („OECD“) konzentriert, auch in Wertpapiere von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern sowie in Wertpapiere von Regierungen von Schwellenländern investieren. Dies kann im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Volkswirtschaften mit zusätzlichen Risiken verbunden sein.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>	11. Juni 2013	AUD
Thesaurierende Klasse CHF A	9. März 2012	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I	20. Dezember 2011	CHF
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1. August 2012	CNY
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	20. Dezember 2011	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A <sup>1</sup>	14. Februar 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	20. Dezember 2011	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	5. Dezember 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	17. Januar 2012	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	20. Dezember 2011	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	21. September 2022	HKD
Thesaurierende Klasse JPY I	28. März 2012	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	19. Oktober 2022	JPY
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>	17. Januar 2014	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	22. Januar 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	20. Dezember 2011	USD
Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>	30. November 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	2. Oktober 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	20. Dezember 2011	USD
Ausschüttende Klasse USD I	9. Januar 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	8. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	20. Dezember 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. April 2014	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Strategic Income

Das Anlageziel des Strategic Income (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamtrendite aus einem hohen laufenden Ertrag und langfristigem Kapitalzuwachs zu erzielen, indem er opportunistisch in einen diversifizierten Mix aus fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln unter unterschiedlichen Marktbedingungen investiert.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel, die von US-Unternehmen oder von der US-Regierung und ihren staatlichen Stellen emittiert werden. Diese Wertpapiere werden an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt und können von anerkannten Ratingagenturen mit Investment-Grade oder darunter bewertet werden oder kein Rating aufweisen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>	15. September 2017	AUD
Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	1. Juli 2019	AUD
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) <sup>1</sup>	7. August 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	14. November 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	22. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) <sup>1</sup>	15. September 2017	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup>	15. September 2017	HKD
Thesaurierende Klasse JPY I	26. April 2013	JPY
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	26. April 2013	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I CG	10. August 2015	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	25. Juni 2014	JPY
Thesaurierende Klasse JPY Z	1. April 2022	JPY
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	SGD
Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>	15. September 2017	SGD
Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	4. Juni 2018	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	11. Februar 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD A	10. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	25. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	26. April 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	10. Dezember 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	30. Juni 2014	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Sustainable Asia High Yield

Anlageziel des Sustainable Asia High Yield (das „Portfolio“) ist es, über einen Marktzyklus (in der Regel 3 Jahre) den JP Morgan JESG JACI High Yield Index (Total Return, USD) vor Gebühren zu übertreffen, indem überwiegend in Hartwährungsanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade investiert wird, die in asiatischen Ländern begeben wurden und den Nachhaltigkeitskriterien gerecht werden.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über einen Marktzyklus noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb eines Marktzyklus erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

Das Portfolio wird vorwiegend in Hartwährungsanleihen ohne Investment Grade und in Geldmarktinstrumente investieren, die von Regierungen oder staatlichen Stellen aus den Ländern Asiens oder von Unternehmen emittiert werden, die ihren Hauptsitz in dieser Region haben oder dort einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben, und die dem Ziel des Portfolios der Förderung ökologischer und sozialer Merkmale Rechnung tragen. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Mit Ausnahme zulässiger Anlagen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, die nicht börsennotiert sind, werden alle Wertpapiere, in die das Portfolio investiert, an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt.

Bei der Entscheidung über die Portfolioanlagen werden der Manager und Sub-Investment-Manager Emittenten bevorzugen, die:

- eine geringe CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität aufweisen. Das Portfolio strebt eine Reduzierung der CO<sub>2</sub>-Emissionen von mindestens 30 % gegenüber dem breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den JPMorgan Asian Credit High Yield Index (der „Index“) repräsentiert wird; und
- bessere ESG-Praktiken (Umwelt, Soziales und Governance) unter Beweis stellen. Das Portfolio strebt, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters, eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den Index repräsentiert wird.

Das Ziel einer geringeren CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität soll dazu dienen, die langfristigen Ziele des Pariser Übereinkommens in Bezug auf die globale Erwärmung zu erreichen.

Darüber hinaus wird das Portfolio bedeutende Allokationen in festverzinsliche Wertpapiere mit Umwelt-, Sozial- und Nachhaltigkeitskennzeichnungen vornehmen und aufgrund dessen je nach Gelegenheiten am Markt ein höheres Engagement in solchen Wertpapieren als der Index aufweisen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR X	28. Januar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP X	8. April 2022	GBP
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	13. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	13. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I	13. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	21. Januar 2022	USD
Ausschüttende Klasse USD Z	22. März 2022	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Das Anlageziel des Sustainable Emerging Market Corporate Debt (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe eine attraktive risikobereinigte Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus in Schwellenländern emittierten Schuldtiteln zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, und die auf die Hartwährungen oder die Währungen dieser Schwellenländer lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse CHF I	28. Juni 2013	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I4	5. November 2019	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	17. Dezember 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	28. Juni 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I3	29. Juli 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	20. Juli 2015	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	28. Juni 2013	GBP
Thesaurierende Klasse SEK A	1. Februar 2018	SEK
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	28. Juni 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	29. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	28. Juni 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	28. Juni 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	25. März 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	11. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD M	3. Oktober 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	3. November 2017	USD

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

Das Anlageziel des Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (das „Portfolio“) ist es, über einen Marktzyklus (in der Regel 3 Jahre) die Benchmark (JPMorgan ESG EMBI Global Diversified Index [Total Return, USD]) vor Gebühren zu übertreffen, indem vorwiegend in auf Hartwährungen lautende Schuldtitel investiert wird, die in Schwellenländern begeben wurden und den nachhaltigen Anlagekriterien gerecht werden.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von öffentlichen oder privaten Emittenten in Schwellenländern emittiert werden, die auf Hartwährungen lauten und mit dem Nachhaltigkeitsziel des Portfolios vereinbar sind. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten auch beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.



## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I3	26. September 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	8. März 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	19. Januar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse USD I	19. Januar 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	27. Januar 2022	USD

### Systematic Global Sustainable Value

Das Anlageziel des Systematic Global Sustainable Value (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die von Unternehmen emittiert werden, welche an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen).

Durch Analysen werden Anlagethemen ermittelt (d. h. Merkmale von Aktien, von denen angenommen wird, dass sie systematisch an die Erwirtschaftung von überdurchschnittlichen Renditen gekoppelt sind). Die Anlagethemen werden zur Beurteilung der Merkmale von Wertpapieremittenten eingesetzt und sind maßgeblich für die Einzeltitelauswahl. Zu den Themen gehören insbesondere die Bewertung, die Ertragsqualität, die Preisdynamik und die Börsenstimmung im Zusammenhang mit den einzelnen Emissionen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	27. September 2022	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	14. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	18. Dezember 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	31. Mai 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	24. Mai 2016	USD

### Ultra Short Term Euro Bond

Das Anlageziel des Ultra Short Term Bond (das „Portfolio“) ist es, über einen Zeitraum von einem Jahr und unabhängig vom Marktumfeld eine attraktive Outperformance gegenüber der Euro-Barrendite zu erzielen, indem in eine diversifizierte Mischung aus kurzfristigen, in Euro denominierten, fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln investiert wird.

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, der in auf Euro lautende Anleihen über eine Vielzahl von Sektoren und Laufzeiten hinweg investiert und dabei eine Kombination aus Top-down- und Bottom-up-Strategien zur Identifizierung einer Vielzahl an Wertquellen einsetzt. Top-down-Strategien konzentrieren sich auf makroökonomische Aspekte sowie Länder- und Sektoranalysen. Bottom-up-Strategien bewerten die Eigenschaften einzelner Instrumente oder Emittenten.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse CHF P	30. Mai 2022	CHF
Thesaurierende Klasse CHF U	17. Dezember 2019	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A	10. Juni 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	31. Oktober 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	31. Oktober 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	27. Februar 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	6. Februar 2019	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Juli 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR U	17. Dezember 2019	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	20. Dezember 2018	EUR
Thesaurierende Klasse USD I	15. September 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	24. Januar 2019	USD

### Uncorrelated Strategies

Das Anlageziel des Uncorrelated Strategies (das „Portfolio“) ist es, aus einem diversifizierten Portfolio unkorrelierter Anlagestrategien Kapitalzuwachs zu erzielen, wobei der Schwerpunkt auf der absoluten Rendite liegt.

Um sein Ziel zu erreichen, verteilt das Portfolio seine Vermögenswerte auf absolut diskretionäre Anlageberater, die verschiedene Anlagestrategien anwenden und weltweit ohne Schwerpunkt auf bestimmte Branchen investieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse CHF I	13. März 2018	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I5	8. September 2017	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A	20. August 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	6. März 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	6. Juli 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	31. Mai 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	15. September 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR P	5. Juli 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	30. Juni 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	6. Juli 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	30. August 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I5	31. Mai 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	2. Oktober 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	29. Juni 2017	GBP
Thesaurierende Klasse JPY I	1. April 2022	JPY
Thesaurierende Klasse SGD A	21. Dezember 2022	SGD
Thesaurierende Klasse USD A	26. Januar 2018	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse USD C1	6. März 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD I	31. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	6. Juli 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	31. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD M	9. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	12. Dezember 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	8. September 2017	USD

### XXXXXXXXXXXXXXXXXX

Das Anlageziel des XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX (das „Portfolio“) ist es, aus einem diversifizierten Portfolio unkorrelierter Anlagestrategien über einen typischen Anlagehorizont (von 3 Jahren) die Benchmark (wie nachstehend definiert) übersteigende Renditen zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, verteilt das Portfolio seine Vermögenswerte auf absolut diskretionäre Anlageberater, die verschiedene Anlagestrategien anwenden und weltweit ohne Schwerpunkt auf bestimmte Branchen investieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR X	14. Juni 2022	EUR
Thesaurierende Klasse USD X	22. Juni 2022	USD

### US Equity

Das Anlageziel des US Equity (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio hauptsächlich in Long-Positionen in Dividendenpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere, die an anerkannten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Das Portfolio kann auch, allerdings in geringerem Umfang, Long- Positionen in Aktien und eigenkapitalbezogenen Wertpapieren eingehen, die an anerkannten Märkten in Ländern notiert sind oder gehandelt werden, welche im MSCI All Country World Index vertreten sind (hierzu können auch Schwellenländer zählen).

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse JPY I3	1. März 2022	JPY
Thesaurierende Klasse USD A	27. März 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I	18. Dezember 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD I	18. Dezember 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD M	9. Februar 2022	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Equity Index PutWrite

Das Anlageziel des US Equity Index PutWrite (das „Portfolio“) ist die Erzielung von langfristigem Kapitalzuwachs und Erträgen.

Das Portfolio strebt sein Ziel vorwiegend mittels einer Strategie an, bei der besicherte Verkaufsoptionen auf globale Aktienindizes und börsengehandelte Fonds („ETFs“) verkauft werden, die ein Engagement an US-Aktienindizes wie dem S&P 500 und Russell 2000 bieten. Die Verkaufsoptionen werden an anerkannten Märkten gehandelt.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR I	13. Februar 2017	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I3	3. Dezember 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4	28. April 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	13. Februar 2017	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	2. März 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I3	11. Mai 2021	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I3	3. Dezember 2021	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	25. Oktober 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	25. August 2021	GBP
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	15. August 2017	SGD
Thesaurierende Klasse USD A	23. Januar 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	18. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	30. Dezember 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I3	3. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I4	28. April 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD M	13. Februar 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	10. Februar 2017	USD

### US Large Cap Value

Das Anlageziel des US Large Cap Value (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Das Portfolio wird vorwiegend in Dividendenpapiere von Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung (Large Caps) investieren, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben und an anerkannten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Die Anlagen des Portfolios in Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung beschränken sich nicht auf bestimmte Sektoren oder Branchen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Large Cap Value (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR A	19. Oktober 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	21. Juni 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	30. März 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	19. April 2022	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	22. März 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	27. Januar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	22. November 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22. November 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	22. November 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22. November 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	14. März 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	8. Juni 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP P	21. Oktober 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	24. Mai 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	30. August 2022	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	24. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I	20. Dezember 2021	USD
Ausschüttende Klasse USD I4	21. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	11. Februar 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	23. Mai 2022	USD

### US Long Short Equity

Das Anlageziel des US Long Short Equity (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen. Sekundäres Ziel ist der Kapitalerhalt.

Um dieses Ziel zu erreichen, wird das Portfolio Long- und synthetische Short-Positionen in Aktien und eigenkapitalbezogenen Wertpapieren, u. a. auch in börsennotierten Fonds („ETFs“), die an Aktienmärkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden, eingehen. Das Portfolio kann auch, allerdings in geringerem Umfang, Long- und synthetische Short-Positionen in Aktien, eigenkapitalbezogenen Wertpapieren und ETFs eingehen, die an anerkannten Märkten in Ländern notiert sind oder gehandelt werden, welche im MSCI All Country World Index vertreten sind (hierzu können auch Schwellenländer zählen). Die Anlagen schließen generell Unternehmen aller Branchen mit einer Marktkapitalisierung von mindestens 250 Mio. USD zum Zeitpunkt der Erstanlage ein.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Long Short Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse EUR A	6. Juli 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	1. Dezember 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I3	13. Mai 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	4. Dezember 2015	EUR
Ausschüttende Klasse GBP I3	8. September 2020	GBP
Thesaurierende Klasse SGD A1	31. Oktober 2014	SGD
Thesaurierende Klasse USD A (PF)	10. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD A	24. Februar 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD A1	3. April 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I (PF)	13. März 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I	28. Februar 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	13. Mai 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD M	9. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD U	6. März 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	15. Mai 2014	USD

### US Multi Cap Opportunities

Das Anlageziel des US Multi Cap Opportunities (das „Portfolio“) ist es, Kapitalzuwachs durch Auswahl von Anlagen auf Basis von systematischem, sequenziellem Research zu erzielen. Um dieses Ziel zu erreichen, wird Neuberger Berman Investment Advisers LLC (der „Sub-Investment-Manager“) durch systematisches, sequenzielles Research potenzielle Anlagen identifizieren. Die Auswahl der Anlagen ist das Ergebnis sowohl quantitativer als auch qualitativer Analysen im Bestreben, Unternehmen zu ermitteln, die das Potenzial für Wertsteigerungen haben. Dieses Potenzial kann auf vielerlei Weise realisiert werden, unter anderem durch: Generierung freier Cashflows, Produkt- oder Verfahrensverbesserungen, Margensteigerung und ein verbessertes Kapitalstrukturmanagement.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse AUD E	2. Juli 2014	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	19. Dezember 2016	AUD
Thesaurierende Klasse EUR I3	21. März 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR1 A	28. Juni 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR1 I	28. Juni 2012	EUR
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	6. November 2017	GBP
Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>	16. Juli 2013	SGD
Thesaurierende Klasse USD B	22. November 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	13. Oktober 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	22. November 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD E	2. Juli 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	29. April 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I3	30. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse USD T	22. November 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD U	22. Januar 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	2. Mai 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD1 A	29. Juni 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD1 I	28. Juni 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD1 I	29. Juni 2012	USD
Thesaurierende Klasse ZAR B	13. Januar 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	13. Januar 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	2. Juli 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	13. Januar 2014	ZAR

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### US Real Estate Securities

Das Anlageziel des US Real Estate Securities (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer Gesamrendite (Total Return) insbesondere durch Kapitalzuwachs sowie aus laufenden Erträgen durch Anlagen in Immobilienwertpapieren. Um dieses Ziel zu erreichen, legt das Portfolio breit gestreut vorwiegend in Wertpapieren (einschließlich Wandelanleihen) an, die von US-amerikanischen REITs ausgegeben werden. Hierbei ist zu beachten, dass das Portfolio nicht direkt Immobilien erwirbt.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>	8. August 2016	AUD
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	16. August 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD B	19. August 2015	AUD
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	16. August 2016	AUD
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	16. August 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	2. Juli 2014	AUD
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	13. Oktober 2015	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	16. Juli 2013	AUD
Thesaurierende Klasse CHF A	11. Oktober 2012	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	1. Februar 2006	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	1. Februar 2006	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup>	28. Juli 2016	HKD
Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>	28. Mai 2013	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>	18. November 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	1. Februar 2006	USD
Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>	21. März 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	15. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD B	16. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	31. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	16. August 2016	USD

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Real Estate Securities (Fortsetzung)

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse USD C2	16. Juli 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	15. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD E	2. Juli 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	19. November 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD I	1. Februar 2006	USD
Ausschüttende Klasse USD I	14. Februar 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31. Dezember 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD T	16. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	10. Februar 2015	USD
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	16. August 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR B	13. März 2015	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	15. August 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	11. April 2019	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	16. August 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	2. Juli 2014	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	26. Juli 2013	ZAR

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### US Small Cap

Das Anlageziel des US Small Cap (das „Portfolio“) ist das Erzielen von Kapitalzuwachs durch Auswahl von Anlagen mittels Analyse von Unternehmenskennzahlen und makroökonomischen Faktoren. Um dieses Ziel zu erreichen, wird das Portfolio vorwiegend in Dividendenpapiere von Unternehmen mit kleiner Marktkapitalisierung investieren, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben und an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Das Portfolio ist bestrebt, unterbewertete Unternehmen zu ermitteln, deren aktueller Marktanteil und Bilanzstatus stark sind und deren finanzielle Stärke größtenteils auf etablierten Geschäftsbereichen und nicht auf projiziertem Wachstum beruht.

Zu den Faktoren bei der Ermittlung dieser Unternehmen gehören:

- Überdurchschnittliche Erträge;
- eine etablierte Marktnische;
- Umstände, die neuen Wettbewerbern den Einstieg in den Markt erschweren;
- die Fähigkeit, ihr eigenes Wachstum zu finanzieren, und
- Solide zukünftige Geschäftsaussichten



## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Small Cap (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse AUD B	25. Oktober 2019	AUD
Thesaurierende Klasse AUD C2	4. September 2018	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	2. Juli 2014	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	19. Dezember 2016	AUD
Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>	28. Juni 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) <sup>1</sup>	18. September 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	6. August 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	16. Oktober 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	24. Januar 2019	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	5. Mai 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	4. Februar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	31. März 2016	EUR
Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	29. Juli 2011	JPY
Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>	5. Juli 2011	USD
Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>	28. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD B	16. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	16. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD E	2. Juli 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I	1. Juli 2011	USD
Ausschüttende Klasse USD I	10. Dezember 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	30. Juli 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD T	16. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	30. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse ZAR E	8. August 2017	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	19. Dezember 2016	ZAR

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### US Small Cap Intrinsic Value

Das Anlageziel des US Small Cap Intrinsic Value (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, wird das Portfolio vorwiegend in Dividendenpapiere von Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung (Small Caps) investieren, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben und an anerkannten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Die Anlagen des Portfolios in Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung beschränken sich nicht auf bestimmte Sektoren oder Branchen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

<i>Name der Anteilklasse</i>	<i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i>	<i>Währung</i>
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	9. März 2021	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	22. Oktober 2021	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	4. Februar 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I	30. April 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	16. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	27. Mai 2016	USD

## Bericht der Direktoren

Die Direktoren legen hiermit ihren Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 sowie Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 vor.

### Aufgaben der Direktoren

Die Direktoren sind verantwortlich für die Erstellung des Jahresberichts und des Jahresabschlusses gemäß geltendem irischem Recht und den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich der Financial Reporting Standards („FRS“) 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“, herausgegeben von Financial Reporting Council und veröffentlicht von den Chartered Accountants Ireland.

Gemäß irischem Recht dürfen die Direktoren den Abschluss nur genehmigen, wenn sie sich vergewissert haben, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild von den Aktiva, Passiva und von der Geschäftslage des Fonds am Ende des Geschäftsjahrs sowie von der Ertragslage des Fonds für das Geschäftsjahr vermittelt.

Bei der Erstellung dieses Abschlusses müssen die Direktoren:

- geeignete Bilanzierungsverfahren auswählen und diese konsequent anwenden;
- Beurteilungen und Schätzungen mit angemessener Sorgfalt und Vorsicht vornehmen;
- feststellen, ob der Abschluss gemäß den anwendbaren Bilanzierungsgrundsätzen aufgestellt wurde, und die angewandten Grundsätze nennen sowie wesentliche Abweichungen von diesen Grundsätzen offenlegen und in den Anmerkungen zum Jahresabschluss erläutern; und
- den Jahresabschluss nach dem Grundsatz der Fortführung der Geschäftstätigkeit des Fonds aufstellen, soweit dieser angenommenen Fortführung nichts entgegensteht.

Die Direktoren sind verantwortlich für eine angemessene Buchführung, die es in hinreichendem Maße ermöglicht:

- die Transaktionen des Fonds korrekt zu erfassen und zu erläutern;
- die Aktiva und Passiva sowie die Finanz- und Ertragslage des Fonds jederzeit mit angemessener Genauigkeit zu ermitteln; und
- sicherzustellen, dass der Jahresabschluss dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „Der im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Finanzberichterstattungsstandard“, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011, in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“), den im Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2015 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) entspricht, und diesen Jahresabschluss zu prüfen.

Die Direktoren sind auch für die Sicherung der Vermögenswerte des Fonds verantwortlich und somit auch für die Ergreifung angemessener Maßnahmen zur Vermeidung und Aufdeckung von Betrugsfällen und anderen Unregelmäßigkeiten.

Gemäß den OGAW-Vorschriften sind die Direktoren verpflichtet, die Vermögenswerte des Fonds bei einer Verwahrstelle in Verwahrung zu geben. In Erfüllung dieser Pflicht hat der Fonds die Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) mit der Verwahrung der Vermögenswerte des Fonds beauftragt.

### Erklärung zu maßgeblichen Prüfungsinformationen

Die zum Datum dieses Berichts im Amt befindlichen Direktoren bestätigen, dass:

- soweit ihm/ihr bekannt, keine prüfungsrelevanten Informationen vorliegen, von denen der Wirtschaftsprüfer des Fonds keine Kenntnis hat; und
- er/sie alle Schritte ergriffen hat, die er/sie als Direktor ergreifen musste, um Kenntnisse von allen maßgeblichen Prüfinformationen zu erhalten und sicherzustellen, dass der Wirtschaftsprüfer des Fonds diese Informationen kennt.

### Entsprechenserklärung der Direktoren

Der Fonds verfolgt den Grundsatz, seine jeweiligen Verpflichtungen (wie im Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) definiert) zu erfüllen. Wie gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) gefordert, bestätigen die Direktoren, dass sie dafür Sorge tragen müssen, dass der Fonds seine jeweiligen Verpflichtungen erfüllt. Die Direktoren haben eine Entsprechenserklärung gemäß Definition in Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie eine Compliance-Richtlinie aufgesetzt, die sich auf die Vorkehrungen und Strukturen bezieht, die vorhanden sind und nach Auffassung der Direktoren für die Sicherstellung konzipiert sind, dass der Fonds seine Verpflichtungen im Wesentlichen erfüllt. Bei der Erfüllung ihrer Aufgaben nach Section 225 vertrauten die Direktoren unter anderem auf von Dritten erbrachten Dienstleistungen, Beratungsleistungen und/oder Erklärungen, von denen die Direktoren überzeugt sind, dass sie über die erforderlichen Kenntnisse und Erfahrung verfügen, um sicherzustellen, dass der Fonds seine Verpflichtungen im Wesentlichen erfüllt.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Geschäftsbücher

Die Direktoren sind gemäß Section 281 des Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) für eine ordnungsgemäße Buchführung verantwortlich. Um dies zu erreichen, haben die Direktoren ein Dienstleistungsunternehmen, Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited, zur Verwaltungsstelle ernannt (die „Verwaltungsstelle“). Die Bücher des Fonds werden am Sitz der Verwaltungsstelle, 30 Herbert Street, Dublin 2, geführt.

### Hauptgeschäftstätigkeit und Überblick über das Geschäft

Der Fonds ist ein Investmentfonds mit variablem Kapital, der am 11. Dezember 2000 als Aktiengesellschaft in Irland gegründet wurde. Der Fonds wurde von der Zentralbank als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den OGAW-Vorschriften genehmigt. Das Ziel des Fonds ist die gemeinsame Anlage von auf dem Kapitalmarkt aufgebrauchten Geldern in Wertpapieren und anderen liquiden finanziellen Vermögenswerten nach dem Grundsatz der Risikostreuung gemäß den OGAW-Vorschriften.

Der Fonds ist als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds organisiert, in denen die Direktoren jeweils mit der vorherigen Genehmigung der Zentralbank verschiedene Serien von Anteilen auflegen können, die gesonderte Portfolios bilden. Die Vermögenswerte jedes Portfolios werden in Einklang mit den für das jeweilige Portfolio geltenden, im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ in diesem Jahresabschluss beschriebenen Anlagezielen angelegt. Jedes Portfolio trägt seine eigenen Verbindlichkeiten, und weder der Fonds noch die vom Fonds ernannten Dienstleistungsanbieter noch die Direktoren, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch eine sonstige Person erhalten Zugriff auf die Vermögenswerte eines Portfolios zur Begleichung von Verbindlichkeiten eines anderen Portfolios.

Am 31. Dezember 2022 bestanden vierundfünfzig Teilfonds, die im Abschnitt Allgemeine Informationen dieses Jahresberichts aufgeführt sind.

### Ergebnisse für das Geschäftsjahr sowie Aktiva, Passiva und Geschäftslage zum 31. Dezember 2022

Ein detaillierter Jahresrückblick und ein Rückblick auf die Faktoren, die im abgelaufenen Jahr zur Performance beigetragen haben, sind in den Berichten des Investment-Managers enthalten. Details zu den Aktiva, Passiva und der Geschäftslage des Fonds und den Ergebnissen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 sind in der Bilanz und der Gewinn- und Verlustrechnung für jedes Portfolio enthalten.

### Direktoren

Die Namen und Nationalitäten der Personen, die zu irgendeinem Zeitpunkt im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 als Direktoren fungierten, sind nachstehend aufgeführt:

Tom Finlay**	Ire
Gráinne Alexander***	Irin
Michelle Green*	Britin
Naomi Daly***	Irin
Alex Duncan*	Brite

\*Nicht geschäftsführender Direktor

\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und ständiger Vorsitzender

\*\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor

### Beteiligungen der Direktoren und des Secretary des Fonds

Zum 31. Dezember 2022 sind Frau Michelle Green und Herr Alex Duncan Direktoren des Fonds sowie Direktoren und Mitarbeiter von Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“), der Manager (bis 30. Juni 2021), Promoter (bis 30. Juni 2021), Sub-Investment-Manager (seit 1. Juli 2021) und die Vertriebsstelle der Gesellschaft. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green auch Direktorin von NBAMIL, der Manager (seit 1. Juli 2021) der Gesellschaft.

Weder die Direktoren noch der Secretary des Fonds noch deren Familienangehörige halten oder hielten am 31. Dezember 2022 oder während des Geschäftsjahres ein wirtschaftliches Eigentum am Fonds. (2021: null).

### Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren

Im Berichtsjahr zum 31. Dezember 2022 gab es zu keinem Zeitpunkt Verträge oder Vereinbarungen von Bedeutung mit Bezug zum Geschäft des Fonds, an denen Direktoren oder der Secretary des Fonds im Sinne der Definition des Companies Act 2014 (in ihrer geltenden Fassung) beteiligt gewesen wären, mit Ausnahme der in Anmerkung 10 dieses Jahresabschlusses offengelegten.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren (Fortsetzung)

#### Verbundene Personen

In Übereinstimmung mit der OGAW-Vorschrift 43(1) der Zentralbank muss eine Transaktion, die vom Manager, von der Verwahrstelle, vom Anlageberater und/oder einem mit diesen Rechtsträgern verbundenem Unternehmen oder einer verbundenen Firmengruppe („verbundene Personen“) mit dem Fonds durchgeführt wird, zu normalen Marktbedingungen ausgehandelt werden. Diese Transaktionen müssen im besten Interesse der Anteilhaber des Fonds sein.

Die Direktoren des Fonds haben sich vergewissert, dass (i) (durch schriftliche Verfahrensanweisungen dokumentierte) Vorkehrungen getroffen wurden, mit denen sichergestellt wird, dass die oben beschriebenen Pflichten bei allen Transaktionen mit verbundenen Parteien erfüllt werden; und dass (ii) bei Transaktionen mit verbundenen Parteien, die im Berichtszeitraum getätigt wurden, diese Pflichten erfüllt wurden.

### Politische Spenden

Im zum 31. Dezember 2022 endenden Jahr wurden keine politischen Spenden geleistet (2021: null).

### Risikomanagementziele und -strategien

Jedes Portfolio ist gemäß den Anlagezielen und der Anlagepolitik für das Portfolio, die im Verkaufsprospekt im Detail beschrieben sind, investiert. Eine Anlage in den einzelnen Portfolios birgt gewisse Risiken, und insbesondere diejenigen, auf die in Anmerkung 12 der Anmerkungen zum Jahresabschluss Bezug genommen wird.

### Ausschüttungen und Einbehaltung

Die im Geschäftsjahr festgesetzten und ausgeschütteten Dividenden werden in der Gewinn- und Verlustrechnung als Finanzierungskosten ausgewiesen.

### Zukünftige Entwicklungen

Der Fonds wird sein im Bericht der Direktoren detailliert beschriebenes Anlageziel weiter verfolgen.

### Sonstige Sachverhalte

Die Invasion der Ukraine durch Russland und die damit zusammenhängenden Ereignisse Ende Februar 2022 haben nachteilige Auswirkungen auf Rohstoffe und die europäische Konjunktur gehabt und dies könnte weiterhin der Fall sein. Das direkte Engagement des Fonds in Russland und der Ukraine ist begrenzt, die Geschäftsleitung wird aber weiterhin potenzielle Auswirkungen auf die Aktivitäten des Fonds überwachen, insbesondere die erhobenen russischen Sanktionen und der Anstieg bei den damit verbundenen makroökonomischen und geopolitischen Risiken.

### Prüfungsausschuss

Der Fonds gründete einen Prüfungsausschuss. Tom Finlay, Gráinne Alexander, Naomi Daly und Alex Duncan sind Direktoren des Fonds und Teil des Prüfungsausschusses.

### Wichtige Ereignisse während des Geschäftsjahres

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres sind in Anmerkung 21 dieses Jahresabschlusses aufgeführt.

### Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres sind in Anmerkung 22 dieses Jahresabschlusses aufgeführt.

### Unabhängige Wirtschaftsprüfer

Die Direktoren haben die unabhängigen Wirtschaftsprüfer, Ernst & Young, Chartered Accountants, im Jahr 2000 zur Prüfung des Abschlusses für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2001 und darauf folgende Rechnungsperioden bestellt.

Um die Qualität und Effektivität der von den amtierenden Abschlussprüfern erbrachten Leistungen mit denen anderer Wirtschaftsprüfungsgesellschaften zu vergleichen, führte der Fonds 2021 ein Ausschreibungsverfahren für die Bestellung seines externen Abschlussprüfers durch. Die Ausschreibung der Abschlussprüfung wurde 2022 abgeschlossen und resultierte in der Wiederbestellung von Ernst & Young zum externen Abschlussprüfer des Fonds.

Die unabhängigen Wirtschaftsprüfer haben ihre Bereitschaft bekundet, auch weiterhin gemäß Section 383(2) des Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) im Amt zu bleiben.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Corporate Governance

Der Fonds unterliegt den irischen Gesetzen in Gestalt des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie den OGAW-Vorschriften. Der Fonds wendet neben den oben beschriebenen keine zusätzlichen Anforderungen an. Alle vom Fonds beauftragten Dienstleister unterliegen ihren eigenen Anforderungen an die Unternehmensführung (Corporate Governance).

#### *Prozess der Finanzberichterstattung – Beschreibung der wichtigsten Merkmale*

Die Direktoren sind verantwortlich für die Einrichtung und Umsetzung geeigneter interner Kontroll- und Risikomanagementsysteme für den Fonds in Bezug auf den Prozess der Finanzberichterstattung. Solche Systeme dienen nicht dazu, das Risiko, dass der Fonds seine Finanzberichterstattungsziele nicht erreicht, zu eliminieren, sondern vielmehr dazu, dieses Risiko zu verwalten, und sie können nur eine angemessene, jedoch keine absolute Absicherung gegen wesentliche Falschdarstellungen oder Verluste bieten.

Die Direktoren haben Prozesse für die internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme eingerichtet, um die effektive Überwachung des Prozesses der Finanzberichterstattung sicherzustellen. Hierfür wurde unter anderem die Verwaltungsstelle mit der Führung der Bücher der Gesellschaft unabhängig vom Manager und der Verwahrstelle beauftragt. Die Verwaltungsstelle ist gemäß den Bestimmungen des Verwaltungsvertrages verpflichtet, für den Fonds ordnungsgemäße Bücher und Aufzeichnungen zu führen. Hierzu nimmt die Verwaltungsstelle regelmäßige Abstimmungen ihrer Aufzeichnungen mit denen der Verwahrstelle vor. Die Verwaltungsstelle ist ferner vertraglich verpflichtet, einen den tatsächlichen Verhältnissen entsprechenden Jahresbericht und Jahresabschluss sowie einen Halbjahresbericht und einen ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zur Prüfung und Genehmigung durch die Direktoren zu erstellen.

Die Direktoren evaluieren und erörtern nach Bedarf wesentliche Fragen der Rechnungslegung und Berichterstattung. Von Zeit zu Zeit prüfen und evaluieren die Direktoren auch die Rechnungslegungs- und Berichtsabläufe und überwachen und evaluieren die Leistung, Qualifikation und Unabhängigkeit der externen Wirtschaftsprüfer. Die Verwaltungsstelle hat die operative Verantwortung in Bezug auf ihre internen Kontrollen für den Prozess der Finanzberichterstattung und den Bericht der Verwaltungsstelle an die Direktoren.

#### *Risikobeurteilung*

Die Direktoren sind verantwortlich für die Beurteilung des Risikos von Unregelmäßigkeiten in der Finanzberichterstattung, die durch Betrug oder Irrtümer verursacht werden, und sie müssen sicherstellen, dass Prozesse vorhanden sind, mit denen interne und externe Faktoren, die möglicherweise Auswirkungen auf die Finanzberichterstattung haben können, frühzeitig identifiziert werden. Die Direktoren haben ferner Prozesse eingerichtet, mit denen Änderungen in den Rechnungslegungsbestimmungen identifiziert und Empfehlungen abgegeben werden, um sicherzustellen, dass diese Änderungen in den Abschlüssen des Fonds korrekt berücksichtigt werden.

Der Manager führt eingehende Überprüfungen der Jahresabschlüsse zwecks Sicherstellung durch, dass sämtliche Inhalte korrekt sind. Sollte eine Unstimmigkeit gefunden werden, würde der Manager dies den Direktoren auf der nächsten Sitzung der Direktoren melden, oder umgekehrt, wenn die Unstimmigkeit als wesentlich erachtet wird. Änderungen an Rechnungslegungsbestimmungen und -standards werden vom Manager und der Verwaltungsstelle der Gesellschaft überwacht, und alle Änderungen werden den Direktoren regelmäßig gemeldet.

Der Manager arbeitet mit der Verwaltungsstelle der Gesellschaft zusammen, damit sichergestellt wird, dass alle Änderungen an Rechnungslegungsbestimmungen und -standards rechtzeitig im Abschluss berücksichtigt werden. Der Manager steht auch in regelmäßigem Kontakt mit den Wirtschaftsprüfern der Gesellschaft.

#### *Kontrolltätigkeiten*

Die Verwaltungsstelle unterhält Kontrollstrukturen, um die Risiken der Finanzberichterstattung zu verwalten. Diese Kontrollstrukturen beinhalten eine geeignete Verteilung der Verantwortlichkeiten und spezifische Kontrolltätigkeiten, die dazu dienen, für jedes wesentliche Konto im Abschluss und die zugehörigen Anmerkungen im Jahresbericht des Fonds das Risiko wesentlicher Mängel in der Finanzberichterstattung aufzudecken bzw. solche zu verhindern. Beispiele für die von der Verwaltungsstelle ausgeübten Kontrolltätigkeiten sind analytische Prüfverfahren, Abstimmungen und automatische Kontrollen in IT-Systemen. Preise, die nicht von unabhängigen Quellen verfügbar sind, werden in der Regel vom Manager mit Hilfe von Methoden bewertet, welche die Direktoren nach Treu und Glauben dahingehend genehmigt haben, dass die aus ihnen resultierende Bewertung den Marktwert eines Wertpapiers widerspiegelt.

#### *Vielfalt*

Was die Vielfalt angeht, so hat der Fonds keine Mitarbeiter und die einzigen Personen, die direkt von ihm beschäftigt werden, sind die Direktoren und die bezeichneten Personen. Bei Vakanzen im Direktorium ist Ziel, sicherzustellen, dass das Direktorium diversifiziert ist und hinsichtlich Alter, Geschlecht, Rasse und Bildungs-/beruflichem Hintergrund eine angemessene Mischung aufweist. Gleichzeitig müssen alle Einzelpersonen die regulatorischen Anforderungen erfüllen und insgesamt eine Zusammensetzung mit den erforderlichen Erfahrungen und Kenntnissen aufweisen. Dies zeigte sich zuletzt 2019 in Form der Ernennung von Naomi Daly und Alex Duncan als Direktoren.

#### *Informationen und Kommunikation*

Die Politik des Fonds und die für die Finanzberichterstattung relevanten Anweisungen der Direktoren werden über geeignete Kanäle, wie z. B. E-Mail, Korrespondenz, Telefon und Meetings, aktualisiert und mitgeteilt, um sicherzustellen, dass alle Informationsanforderungen an die Finanzberichterstattung vollständig und korrekt erfüllt werden.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Corporate Governance (Fortsetzung)

#### *Überwachung*

Die Direktoren erhalten regelmäßige Präsentationen und Prüfberichte von der Verwahrstelle, dem Manager und der Verwaltungsstelle. Die Direktoren wenden ferner einen jährlichen Prozess an, um sicherzustellen, dass geeignete Maßnahmen getroffen werden, damit die von den unabhängigen Wirtschaftsprüfern identifizierten Mängel und empfohlenen Maßnahmen berücksichtigt werden.

#### *Kapitalstruktur*

Keine Person hat eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung an Wertpapieren des Fonds. Keine Person hat irgendwelche Sonderkontrollrechte über das Anteilkapital des Fonds. Es bestehen keine Beschränkungen hinsichtlich der Stimmrechte. Bezüglich der Ernennung und Ablösung von Direktoren unterliegt der Fonds den Bestimmungen seiner Satzung, den irischen Gesetzen in Gestalt des Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) sowie den OGAW-Vorschriften. Die Satzung selbst kann durch Sonderbeschluss der Anteilinhaber geändert werden.

#### *Befugnisse der Direktoren*

Die Direktoren sind verantwortlich für die Führung der Geschäfte des Fonds in Einklang mit der Satzung. Die Direktoren können bestimmte Funktionen an die Verwaltungsstelle und andere Parteien delegieren, vorbehaltlich der Überwachung und Anleitung durch die Direktoren. Die Direktoren haben dem Manager bestellt, um die Geschäfte der Gesellschaft auf Tagesbasis zu verwalten, und sie haben für diesen Zweck bestimmte Aufgaben und Befugnisse auf den Manager übertragen. Die Direktoren werden vom Manager regelmäßige Berichte erhalten, in denen unter anderem die Prüfung der Wertentwicklung der Gesellschaft und der Portfolios durch den Manager und eine Analyse der jeweiligen Anlageportfolios bereitgestellt werden. Darüber hinaus stellt der Manager alle sonstigen Informationen zur Verfügung, die den Direktoren von Zeit zu Zeit in angemessener Weise für die Zwecke solcher Sitzungen bereitzustellen sind. Die Direktoren haben die Verwahrstelle zur sicheren Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft ernannt. Dementsprechend ist keiner der Direktoren ein geschäftsführender Direktor. Die Satzung sieht vor, dass die Direktoren alle Befugnisse der Gesellschaft ausüben können, Gelder aufzunehmen und die Gesellschaft, deren Eigentum oder Teile desselben zu beleihen oder zu belasten, und alle diese Befugnisse an den Manager delegieren können.

Die Direktoren können jederzeit nach entsprechender Mitteilung an die Verwahrstelle die Berechnung des Nettoinventarwerts eines bestimmten Portfolios sowie die Ausgabe, Bewertung, den Verkauf, Kauf, die Rücknahme oder den Umtausch von Anteilen und/oder die Zahlung von Rücknahmeerlösen jederzeit unter folgenden Umständen vorübergehend aussetzen:

- a) in Zeiträumen, in denen ein anerkannter Markt, an dem ein wesentlicher Teil der Anlagen, aus denen sich zum betreffenden Zeitpunkt das betreffende Portfolio zusammensetzt, notiert ist oder gehandelt wird, geschlossen ist (mit Ausnahme normaler Feiertage) oder in denen der Handel an einem solchen anerkannten Markt beschränkt oder ausgesetzt ist;
- b) in Zeiträumen, in denen infolge von politischen, militärischen, wirtschaftlichen oder geldpolitischen Ereignissen oder anderen Umständen, auf die die Direktoren keinen Einfluss haben bzw. für die die Direktoren nicht verantwortlich sind, die Veräußerung oder Bewertung von Anlagen, aus denen sich zum betreffenden Zeitpunkt das betreffende Portfolio zusammensetzt, nicht normal oder nicht ohne Schaden für die Interessen der Anteilinhaber durchgeführt oder abgeschlossen werden kann;
- c) im Falle eines Ausfalls der normalerweise zur Ermittlung des Wertes von Anlagen, die zum betreffenden Zeitpunkt im betreffenden Portfolio enthalten sind, eingesetzten Kommunikationsmittel oder in Zeiträumen, in denen aus anderen Gründen der Wert von Anlagen, die zum betreffenden Zeitpunkt im betreffenden Portfolio enthalten sind, nach Einschätzung der Direktoren nicht pünktlich oder genau ermittelt werden kann;
- d) in Zeiträumen, in denen der Fonds nicht in der Lage ist, Gelder zu repatriieren, um Rücknahmezahlungen zu leisten, oder in denen die Realisierung von Anlagen, die zum betreffenden Zeitpunkt im betreffenden Portfolio enthalten sind, oder die Übertragung oder Zahlung von Geldern im Zusammenhang damit nach Einschätzung der Direktoren nicht zu normalen Preisen oder normalen Wechselkursen möglich ist;
- e) in Zeiträumen, in denen infolge widriger Marktbedingungen die Zahlung von Rücknahmeerlösen nach Einschätzung der Direktoren negative Auswirkungen auf den betreffenden Portfolio oder die verbleibenden Anteilinhaber des Portfolios haben kann;
- f) in Zeiträumen nach einer Einberufung einer Anteilinhaberversammlung zwecks Auflösung des Fonds oder eines Portfolios bis einschließlich zum Datum dieser Anteilinhaberversammlung;
- g) in Zeiträumen, in denen der Handel eines Organismus für gemeinsame Anlagen, in den das Portfolio einen wesentlichen Teil seines Vermögens investiert hat, ausgesetzt ist;
- h) in Zeiträumen, in denen die Rücknahme von Anteilen nach Einschätzung der Direktoren zu einer Verletzung geltender Gesetze führen würde; oder
- i) in Zeiträumen, in denen die Direktoren feststellen, dass dies im besten Interesse der Anteilinhaber liegt.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Corporate Governance (Fortsetzung)

#### *Befugnisse der Direktoren (Fortsetzung)*

Die Mitteilung einer solchen Aussetzung wird, wenn sie nach Einschätzung der Direktoren wahrscheinlich länger als 30 Tage andauern wird, durch die Gesellschaft an deren eingetragenem Sitz sowie in den Zeitungen und sonstigen Medien, die die Direktoren von Zeit zu Zeit festlegen, veröffentlicht und unverzüglich der Zentralbank und den Anteilhabern übermittelt. Die Anträge von Anteilhabern auf Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen einer Serie oder Klasse werden am ersten Handelstag nach Beendigung der Aussetzung bearbeitet, sofern Zeichnungs- bzw. Rücknahmeanträge nicht vor Beendigung der Aussetzung zurückgezogen wurden. Es werden nach Möglichkeit alle angemessenen Schritte unternommen, um einen Aussetzungszeitraum so schnell wie möglich zu beenden.

Registrierte Anteile können in einer von den Direktoren genehmigten Form bargeldlos auf einen anderen wirtschaftlichen Eigentümer übertragen werden. Die Übertragungsurkunde eines Anteils muss vom oder im Namen des Übertragenden unterschrieben sein. Die übertragende Partei ist bis zur Eintragung des Namens des Erwerbers im Register als Inhaber der betreffenden Anteile zu betrachten.

Die Direktoren können es ablehnen, eine Übertragung zu registrieren, wenn ihnen bekannt ist oder sie berechtigten Grund zu der Annahme haben, dass die Übertragung zu einem wirtschaftlichen Eigentum von Anteilen durch eine Person führen würde, die gegen die von den Direktoren festgelegten Beschränkungen verstoßen würde oder rechtliche, aufsichtsrechtliche, finanzielle, steuerliche oder wesentliche verwaltungstechnische Nachteile für das betreffende Portfolio oder die Anteilhaber im Allgemeinen verursachen könnte.

#### *Versammlungen der Anteilhaber*

Die Jahreshauptversammlung des Fonds wird in Irland abgehalten, normalerweise im Juni oder zu einem anderen Zeitpunkt, den die Direktoren festlegen können. Die Einberufungsmittelung zur Jahreshauptversammlung, auf der der geprüfte Jahresabschluss des Fonds (zusammen mit dem Bericht der Direktoren und dem Bericht der Wirtschaftsprüfer des Fonds) vorgelegt wird, wird den Anteilhabern an ihre registrierte Adresse spätestens 21 Kalendertage vor dem für die Versammlung festgelegten Termin zugesandt. Weitere Hauptversammlungen können von Zeit zu Zeit durch die Direktoren in der nach irischem Recht vorgesehenen Weise einberufen werden.

Jeder Anteil verleiht dem Inhaber das Recht, an den Versammlungen des Fonds und des durch diese Anteile repräsentierten Portfolios teilzunehmen und dort seine Stimme abzugeben. Alle Abstimmungen erfolgen durch Abstimmung mit Stimmzetteln durch die persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter auf der jeweiligen Anteilhaberversammlung anwesenden Anteilhaber oder durch einstimmigen schriftlichen Beschluss der Anteilhaber. Keine Anteilklasse verleiht ihrem Inhaber Vorzugs- oder Bezugsrechte oder irgendwelche Rechte auf Beteiligung an Gewinnen anderer Anteilklassen oder auf Stimmrechte, die sich ausschließlich auf andere Anteilklassen betreffende Angelegenheiten beziehen.

Jeglicher Beschluss zur Änderung der Klassenrechte der Anteile erfordert die Zustimmung von drei Vierteln der Anteilhaber, welche bei einer Hauptversammlung der Klasse vertreten bzw. anwesend sind bzw. ihre Stimme abgeben. Die beschlussfähige Mehrheit für eine zur Prüfung einer Änderung der Rechte einer Anteilklasse anberaumten Hauptversammlung besteht aus zwei oder mehr persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter anwesende Personen, die ausgegebene Anteile dieser Klasse halten. Falls auf einer Versammlung keine beschlussfähige Mehrheit vorhanden ist und die Versammlung vertagt wird, beträgt die beschlussfähige Mehrheit für die vertagte Versammlung einen Anteilhaber, der persönlich oder durch einen Stimmrechtsvertreter anwesend ist.

Jeder Anteil mit Ausnahme der Zeichneranteile berechtigt den Anteilhaber zu einer gleichen (vorbehaltlich etwaiger Unterschiede in den für die unterschiedlichen Anteilklassen geltenden Gebühren und Kosten), verhältnismäßigen Beteiligung an den Gewinnen und dem Nettovermögen des Portfolios, in Bezug auf den diese Anteile ausgegeben wurden. Ausgenommen hiervon sind Gewinne, die bereits festgestellt wurden, bevor die betreffende Person Anteilhaber wurde.

Zeichneranteile berechtigen ihre Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf allen Hauptversammlungen des Fonds, berechtigen die Inhaber jedoch nicht, am Gewinn oder am Nettovermögen des Fonds zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation.

#### *Zusammensetzung und Tätigkeit der Direktoren und ihrer Ausschüsse*

Zurzeit gibt es 5 Direktoren, die alle nicht geschäftsführende Direktoren sind. Frau Michelle Green ist Direktorin des Fonds und war bis 15. Februar 2023 auch bei der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited, dem Manager des Fonds, angestellt. Die Satzung sieht keine Ablösung der Direktoren durch Rotation vor. Die Direktoren können jedoch von den Anteilhabern durch einfachen Mehrheitsbeschluss gemäß dem im Irish Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) festgelegten Verfahren abberufen werden. Die Direktoren kommen mindestens einmal pro Quartal zusammen. Abgesehen vom Prüfungsausschuss gibt es keine dauerhaft autorisierten Unterausschüsse der Direktoren.

Die Direktoren haben sich vergewissert, dass die Direktoren über ausreichend Zeit verfügen, um ihren Pflichten nachzukommen und den Direktoren ihre sonstigen Verpflichtungen schriftlich mitzuteilen, einschließlich Direktorenposten bei anderen Organismen für gemeinsame Anlagen und außerhalb von Fonds.

#### *Unternehmensführungskodex (Corporate Governance Code) der Irish Funds*

Die Irish Funds („IF“) hat einen Unternehmensführungskodex (Corporate Governance Code, „IF Code“) herausgegeben, den irische zugelassene Organismen für gemeinsame Anlagen auf freiwilliger Basis übernehmen können. Es ist zu beachten, dass der IF Code bestehende Praktiken der Unternehmensführung widerspiegelt, die irischen zugelassenen Organismen für gemeinsame Anlagen auferlegt wurden, wie vorstehend angemerkt. Wird der IF Code auf freiwilliger Basis übernommen, kann darauf in den Offenlegungen im Bericht der Direktoren gemäß den Bestimmungen der EG-Richtlinien (Richtlinie 2006/46/EG) (Durchführungsverordnung Nr. 450 von 2009 und Durchführungsverordnung Nr. 83 von 2010) verwiesen werden.

Mit Wirkung vom 1. Januar 2013 haben die Direktoren auf freiwilliger Basis den von der Irish Funds veröffentlichten Corporate Governance Code for Irish Domiciled Collective Investment Schemes als Unternehmensführungskodex des Fonds übernommen.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Corporate Governance (Fortsetzung)

Im Namen der Direktoren

**Direktor:**

**Tom Finlay**

---

Datum: 19. April 2023

**Direktor:**

**Naomi Daly**

---

Datum: 19. April 2023



## Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber

In unserer Eigenschaft als Verwahrstelle des Fonds haben wir das Geschäftsverhalten der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) in dem am 31. Dezember 2022 geendeten Geschäftsjahr überprüft.

Dieser Bericht, einschließlich des Prüfvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilhaber des Fonds als Gremium gemäß Teil 5 der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) und für keinen anderen Zweck erstellt. Mit diesem Prüfvermerk akzeptieren oder übernehmen wir keine Verantwortung für irgendeinen anderen Zweck oder gegenüber irgendeiner Person, der dieser Bericht vorgelegt wird.

### Aufgaben der Verwahrstelle

Unsere Aufgaben und Verantwortlichkeiten sind in Teil 5 der OGAW-Vorschriften umrissen. Eine dieser Aufgaben ist es, uns einen Überblick über die Geschäftstätigkeit des Fonds in jedem jährlichen Bilanzierungszeitraum zu verschaffen und den Anteilhabern darüber Bericht zu erstatten.

Unser Bericht muss angeben, ob nach unserer Meinung der Fonds in diesem Berichtszeitraum in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung des Fonds sowie der OGAW-Vorschriften verwaltet wurde. Die Einhaltung dieser Bestimmungen obliegt dem Fonds. Sollte der Fonds diese nicht eingehalten haben, müssen wir als Verwahrstelle angeben, warum dies der Fall ist und die Maßnahmen erläutern, die wir zur Behebung der Situation ergriffen haben.

### Grundlage des Prüfvermerks der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle führt die Prüfungen durch, die sie nach ihrem vernünftigen Ermessen für notwendig hält, um ihre wie in Teil 5 der OGAW-Vorschriften beschriebenen Pflichten erfüllen zu können und um sicherzustellen, dass der Fonds in jeder wesentlichen Hinsicht (i) gemäß den Beschränkungen seiner Anlage- und Kreditbefugnisse geführt wurde, die ihm durch die Bestimmungen seiner Gründungsdokumente und den entsprechenden Vorschriften auferlegt wurden, und (ii) auch ansonsten gemäß den Gründungsdokumenten des Fonds und den entsprechenden Vorschriften geführt wurde.

### Prüfvermerk

Unserer Meinung nach ist der Fonds in diesem Geschäftsjahr in jeder wesentlichen Hinsicht:

- (i) gemäß den Beschränkungen, die die Gründungsurkunde, die Satzung, die OGAW-Vorschriften und die Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) den Anlage- und Kreditbefugnissen des Fonds auferlegen, und
- (ii) auch sonst in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Vorschriften der Zentralbank verwaltet worden.

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited  
30 Herbert Street  
Dublin 2  
Irland

Datum: 19. April 2023

# Bericht des unabhängigen Wirtschaftsprüfers an die Gesellschafter der Neuberger Berman Investment Funds Plc

## Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

### Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (die „Gesellschaft“) für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr geprüft, der aus den Bilanzen, den Gewinn- und Verlustrechnungen, den Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens und den Anmerkungen zum Jahresabschluss besteht, einschließlich der in Anmerkung 1 beschriebenen Zusammenfassung der Bilanzierungsgrundsätze. Der bei der Aufstellung angewandte Rahmen für die Finanzberichterstattung umfasst irisches Recht und FRS 102, den im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendenden Rechnungslegungsstandard, herausgegeben im Vereinigten Königreich vom Financial Reporting Council.

Unserer Meinung nach:

- vermittelt der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild von den Aktiva und Passiva und von der Geschäftslage des Fonds zum 31. Dezember 2022 und seinem Verlust für das dann beendete Geschäftsjahr;
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß im Einklang mit FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ erstellt; und
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß im Einklang mit den Vorschriften des Companies Act von 2014, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und den Central Bank (Supervision and Enforcement Act) 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2019 erstellt.

### Grundlage für das Testat

Unsere Prüfung erfolgte gemäß den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing (Ireland) (ISAs (Ireland))) und geltendem Recht. Unsere Aufgaben gemäß diesen Standards sind im Abschnitt Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung unseres Berichts ausführlicher beschrieben. Wir sind im Einklang mit den berufsethischen Anforderungen, die für unsere Abschlussprüfung in Irland maßgeblich sind, einschließlich des von der Irish Auditing and Accounting Supervisory Authority (IAASA) herausgegebenen Ethical Standard, von der Gesellschaft unabhängig und haben unsere sonstigen berufsethischen Obliegenheiten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Testats ausreichend und angemessen.

### Feststellungen zur Unternehmensfortführung

Im Rahmen der Abschlussprüfung haben wir festgestellt, dass die Bilanzierung auf der Grundlage der Unternehmensfortführung bei der Aufstellung des Abschlusses durch die Direktoren angemessen ist.

Auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft wecken können, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum der Freigabe des Jahresabschlusses die Unternehmensfortführung sicherzustellen.

Unsere Aufgaben und die Aufgaben der Direktoren im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung sind in den einschlägigen Abschnitten dieses Berichts beschrieben. Weil sich aber nicht alle künftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhersagen lassen, ist diese Erklärung keine Garantie dafür, dass die Gesellschaft auch künftig zur Unternehmensfortführung in der Lage ist.

### Sonstige Informationen

Die Direktoren sind zuständig für die sonstigen Informationen. Zu den sonstigen Informationen gehören die neben dem im Jahresabschluss und unserem Bericht des Wirtschaftsprüfers im Jahresbericht enthaltenen Informationen. Unser Testat zum Jahresabschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und, soweit in unserem Bericht nicht ausdrücklich anders angegeben, geben wir diesbezüglich keinerlei Urteil mit Prüfungssicherheit ab.

Es ist unsere Aufgabe, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei abzuwägen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Widerspruch zum Jahresabschluss oder unseren im Prüfungsverlauf erlangten Kenntnissen stehen oder anderweitig eine wesentliche Falschdarstellung zu enthalten scheinen. Stellen wir solche wesentlichen Widersprüche oder augenscheinlichen wesentlichen Falschdarstellungen fest, müssen wir ermitteln, ob es sich um eine wesentliche Falschdarstellung im Abschluss oder um eine wesentliche Falschdarstellung in den sonstigen Informationen handelt. Wenn wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeiten zu dem Schluss gelangen, dass diese sonstigen Informationen eine wesentliche Falschdarstellung enthalten, müssen wir diesen Sachverhalt melden.

Wir haben diesbezüglich keine Angaben zu machen.

# Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Gesellschafter der Neuberger Berman Investment Funds Plc (Fortsetzung)

## Vom Companies Act von 2014 vorgeschriebene Stellungnahmen zu sonstigen Sachverhalten

Ausschließlich auf der Grundlage der im Prüfungsverlauf durchgeführten Arbeiten geben wir an, dass unserer Auffassung nach:

- die im Bericht der Direktoren für den zum Ende des Geschäftsjahres erstellten Jahresabschluss enthaltenen Angaben mit dem Jahresabschluss übereinstimmen; und
- der Bericht der Direktoren gemäß den geltenden rechtlichen Verpflichtungen erstellt wurde.

Wir haben sämtliche Informationen und Erklärungen erhalten, die wir nach unserem besten Wissen und Gewissen für die Zwecke unserer Prüfung als notwendig erachten.

Die Geschäftsbücher des Fonds ließen unserer Auffassung nach jederzeit eine ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu und der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

## Angelegenheiten, über die wir im Ausnahmefall berichten müssen

Auf der Grundlage unserer im Verlauf der Prüfung erlangten Kenntnis und des Verständnisses des Fonds und seines Umfelds haben wir im Bericht der Direktoren keine wesentlichen Falschdarstellungen festgestellt.

Der Companies Act von 2014 schreibt vor, dass wir Ihnen mitteilen müssen, wenn unserer Auffassung nach von Section 305 bis 312 des Companies Act vorgeschriebene Informationen, die sich auf Angaben der Vergütung und Transaktionen von Direktoren beziehen, vom Fonds nicht erteilt wurden. Wir haben diesbezüglich keine Angaben zu machen.

## Jeweilige Aufgaben

### Aufgaben der Direktoren im Hinblick auf den Jahresabschluss

Wie in der Beschreibung der Aufgaben der Direktoren auf Seite 36 ausführlicher erläutert, sind die Direktoren zuständig für die Aufstellung des Abschlusses gemäß dem geltenden Rahmen für die Finanzberichterstattung, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt, und die von ihnen als notwendig erachteten internen Kontrollen, um eine Aufstellung des Jahresabschlusses ohne wesentliche Falschdarstellungen aufgrund von Betrug oder Irrtum zu ermöglichen.

Bei der Aufstellung des Abschlusses sind die Direktoren zuständig für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung und gegebenenfalls für die Angabe von Sachverhalten im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung und der Bilanzierung auf der Grundlage der Unternehmensfortführung, sofern das Management nicht entweder beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren beziehungsweise den Betrieb einzustellen oder keine realistische Alternative dazu hat.

### Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

Unser Ziel ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss frei von wesentlichen Falschdarstellungen ist, gleich ob aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Bericht des Wirtschaftsprüfers herauszugeben, der unser Testat enthält. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine gemäß ISAs (Ireland) durchgeführte Abschlussprüfung bestehende wesentliche Falschdarstellungen in jedem Fall aufdeckt. Falschdarstellungen können aufgrund von Betrug oder Irrtum entstehen und gelten als wesentlich, wenn nach vernünftigem Ermessen davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Ausführlicher beschrieben sind unsere Aufgaben im Hinblick auf die Abschlussprüfung auf der IAASA-Website unter:

[http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf).

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Wirtschaftsprüfers.

## Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Gesellschafter der Neuberger Berman Investment Funds Plc (Fortsetzung)

### **Jeweilige Aufgaben (Fortsetzung)**

#### **Der Zweck unserer Prüfungshandlungen und die Personen, gegenüber denen wir in der Verantwortung stehen**

Unser Bericht wurde ausschließlich für die Gesellschafter des Fonds als Gremium gemäß Section 391 des Companies Act von 2014 erstellt. Wir haben unsere Abschlussprüfung so durchgeführt, dass wir den Gesellschaftern des Fonds diejenigen Sachverhalte mitteilen können, die ihnen in einem Wirtschaftsprüferbericht mitgeteilt werden müssen, nicht aber zu einem anderen Zweck. Soweit gesetzlich zulässig, akzeptieren bzw. übernehmen wir die Verantwortung für unsere Prüfung, diesen Bericht bzw. für die zum Ausdruck gebrachten Meinungen lediglich gegenüber dem Fonds und den Gesellschaftern des Fonds als Gremium.

Lisa Kealy  
für und im Auftrag von  
Ernst & Young Chartered Accountants and Statutory Audit Firm  
Dublin

**Datum: 24. April 2023**

# Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Direktoren der Neuberger Berman Investment Funds Plc

Die Direktoren  
Neuberger Berman Investment Funds plc

## Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (der „Fonds“) geprüft, der aus der Bilanz zum 31. Dezember 2022, der Gewinn- und Verlustrechnung, der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens für das dann beendete Geschäftsjahr und den Anmerkungen zum Jahresabschluss besteht.

Nach unserer Meinung stellt der Jahresabschluss in allen wesentlichen Aspekten die Bilanzen des Fonds zum 31. Dezember 2022 und seine Betriebsergebnisse sowie die Veränderungen des Nettovermögens gemäß den Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich FRS 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ (in Irland allgemein anerkannte Bilanzierungsgrundsätze – irische GAAP), angemessen dar.

## Grundlage für das Testat

Wir haben den Jahresabschluss nach den allgemein in den USA anerkannten Prüfungsgrundsätzen (GAAS) geprüft. Unsere Aufgaben gemäß diesen Standards sind im Abschnitt „Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung“ unseres Berichts ausführlicher beschrieben. Wir sind verpflichtet, vom Fonds unabhängig zu sein und unseren sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß den einschlägigen ethischen Anforderungen in Zusammenhang mit unserer Prüfung nachzukommen. Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Testats ausreichend und angemessen.

## Aufgaben des Managements im Hinblick auf den Jahresabschluss

Das Management ist verantwortlich für die Erstellung und angemessene Darstellung des Rechnungsabschlusses in Einklang mit den Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich FRS 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ (in Irland allgemein anerkannte Bilanzierungsgrundsätze – irische GAAP), sowie die Entwicklung, Implementierung und Aufrechterhaltung interner Kontrollen, die für die Erstellung und angemessene Darstellung des Rechnungsabschlusses ohne wesentliche Falschdarstellungen aufgrund von Betrug oder Irrtum maßgeblich sind.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses obliegt es dem Management, zu beurteilen, ob Bedingungen oder Ereignisse vorliegen, die in ihrer Gesamtheit erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung innerhalb eines Jahres nach dem Datum, an dem der Jahresabschluss zur Veröffentlichung verfügbar ist, aufkommen lassen.

## Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

Unser Ziel ist es, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss frei von wesentlichen Falschdarstellungen ist, gleich ob aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Bericht des Wirtschaftsprüfers herauszugeben, der unser Testat enthält. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine absolute Sicherheit und somit keine Garantie dafür, dass eine gemäß GAAS durchgeführte Abschlussprüfung bestehende wesentliche Falschdarstellungen in jedem Fall aufdeckt. Das Risiko, dass eine wesentliche Falschdarstellung aufgrund von Betrug nicht aufgedeckt wird, ist höher als das Risiko der Aufdeckung einer wesentlichen Falschdarstellung aufgrund von Irrtum, da Betrug unter Umständen mit Absprachen, Fälschungen, absichtlichen Auslassungen, Fehldarstellungen oder der Umgehung interner Kontrollen einhergeht. Falschdarstellungen gelten als wesentlich, wenn in erheblichem Maße davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder insgesamt das Urteil eines vernünftigen Nutzers bei Heranziehen des Jahresabschlusses beeinflussen würden.

Bei der Durchführung einer Prüfung in Übereinstimmung mit den GAAS gehen wir wie folgt vor:

- Wir treffen ein professionelles Urteil und wahren während der gesamten Prüfung eine professionelle Skepsis.
- Wir identifizieren und beurteilen die Risiken wesentlicher Falschdarstellungen im Jahresabschluss, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, und planen und führen unsere Prüfungshandlungen dergestalt aus, damit diesen Risiken Rechnung getragen wird. Derlei Prüfungshandlungen erstrecken sich auf Stichproben der Nachweise für die Beträge und Angaben im Jahresabschluss.
- Wir erlangen ein Verständnis der prüfungsrelevanten internen Kontrollen, um die unter den gegebenen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch, um ein Testat über die Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben. Daher wird kein diesbezügliches Urteil abgegeben.
- Wir beurteilen die Angemessenheit der Bilanzierungsgrundsätze und der wesentlichen, seitens des Managements gemachten Schätzungen sowie die allgemeine Darstellung des Abschlusses.
- Wir schlussfolgern ob nach unserem Ermessen Bedingungen oder Ereignisse vorliegen, die in ihrer Gesamtheit erhebliche Zweifel an der Fähigkeit eines jeden Fonds zur Unternehmensfortführung während eines angemessenen Zeitraums aufkommen lassen.

Wir sind verpflichtet, den Governance-Verantwortlichen unter anderem den geplanten Umfang und den Zeitplan der Prüfung, wesentliche Feststellungen im Rahmen der Prüfung und bestimmte identifizierte Sachverhalte bezogen auf die interne Kontrolle mitzuteilen.

## Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Direktoren der Neuberger Berman Investment Funds Plc (Fortsetzung)

### **Sonstige Informationen**

Das Management ist zuständig für die sonstigen Informationen. Zu den sonstigen Informationen gehören die im Jahresabschluss enthaltenen Informationen, aber nicht die Abschlüsse und der Bericht unseres Wirtschaftsprüfers hierüber. Unser Prüfungsurteil zu den Jahresabschlüssen erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir geben hierzu keinerlei Prüfungsurteil oder irgendeine Form der Zusicherung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses ist es unsere Aufgabe, die sonstigen Informationen zu lesen und abzuwägen, ob zwischen den sonstigen Informationen und dem Jahresabschluss ein wesentlicher Widerspruch besteht oder die sonstigen Informationen anderweitig eine wesentliche Falschdarstellung zu enthalten scheinen. Wenn wir auf der Grundlage der durchgeführten Arbeiten zu dem Schluss kommen, dass eine nicht richtiggestellte wesentliche Falschdarstellung der sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, diese in unserem Bericht darzulegen.

Ernst & Young  
Dublin, Irland  
24. April 2023

## 5G Connectivity – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -43,15 %. Der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -18,36 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

2022 war ein ungewöhnliches Jahr, das von der höchsten Inflation und den schnellsten Zinserhöhungen der Zentralbanken seit 40 Jahren geprägt war. Während die globalen Aktienmärkte das Jahr mit hohen Bewertungen begannen, gaben Long-Duration- und Mega-Cap-Technologiewerte in der Folge deutlich nach. Beispielsweise verzeichnete der MSCI ACWI IT Index im Jahresverlauf eine Rendite von -31,07 %. Die Marktvolatilität war in diesem Berichtszeitraum hoch und die Stimmung, bedingt durch Rezessionsorgen und geopolitischen Spannungen, schlecht. Dies führte zu einem umfassenden Risikoabbau und Marktrotationen weg von Wachstumsaktien.

Vor diesem schwierigen makroökonomischen Hintergrund schnitt das Portfolio im Berichtszeitraum schwächer ab als der Index. Aufgeschlüsselt nach Sektoren gingen die größten Wertabzüge auf das Konto einer Übergewichtung von Informationstechnologie. Vor allem das Engagement des Portfolios in wachstumsstarken Bereichen wie Software und Halbleiter sowie zyklischen Sektoren entwickelte sich schwach, da diese mit einer Wachstumsnormalisierung und makroökonomischer Schwäche zu kämpfen hatten. Aus regionaler Sicht wirkte sich eine im Vergleich zur Benchmark höhere Allokation zu China nachteilig aus, da die COVID-bedingten Lockdowns und politischen Veränderungen anhielten. Auf der anderen Seite hielt sich das Engagement in Industrierwerten und mehr defensiven Wachstumsbereichen wie Telekommunikation besser.

Im Jahr 2022 haben wir Wachstumsfallen vermieden und den Schwerpunkt auf Wachstum zu einem angemessenen Preis gesetzt. Wir reduzierten unser Engagement in den wachstumsstarken Segmenten Internet und Software sowie in Unterhaltungselektronik. Stattdessen konzentrierten wir uns auf Bereiche mit einem positiven säkularen Rückenwind (5G-Infrastruktur, Industrierwerte), defensivem Wachstum (Telekommunikation) und solider Ertragskraft (führende Halbleiter).

Mit Blick auf 2023 wird erwartet, dass sich das Tempo der Zinserhöhungen zwar verlangsamen wird, die Zinsen aber noch länger hoch gehalten werden und die makroökonomische Unsicherheit anhalten könnte. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber durchaus bereit, taktische Gelegenheiten zu nutzen und uns für zyklisches Wachstum zu positionieren. Was die Beschleunigung der 5G-Einführung, die strategische Halbleiterindustrie, die Verbreitung der industriellen Automatisierung und Elektrifizierung sowie die Hauptnutznießer und Befähiger der digitalen Transformation angeht, sind wir positiv gestimmt. Angesichts der Marktvolatilität betonen wir die Bedeutung des geschickten Agierens und beabsichtigen die Ausnutzung von Verzerrungen an den Märkten, um auf höherwertige Engagements zu setzen, wo wir zusätzliche positive Aussichten, eine bessere Ertragskraft und eine Bestätigung unserer 5G-Anlagethesen sehen.

## Asian Debt - Hard Currency – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -13,50 %. Im selben Zeitraum rentierte der JP Morgan Asia Credit Index (Total Return, USD) (der „Index“) -11,02 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Auf dem asiatischen Anleihenmarkt kam es im Berichtszeitraum zu deutlichen Rückgängen, die vorrangig auf die Entwicklung des chinesischen Immobiliensektors zurückzuführen waren. Unter dem Mantra des „gemeinsamen Wohlstands“ setzten die chinesischen Behörden ihre Politik des erzwungenen Schuldenabbaus im Immobiliensektor fort. Daraus resultierten ein hohes Maß an Kreditstress und eine große Zahl von Ausfällen auf dem Markt. Außerhalb des chinesischen Immobiliensektors schnitten die asiatischen Märkte für in Hartwährung denominierte Anleihen vergleichsweise besser ab. Dennoch verzeichneten sie negative Renditen für das Kalenderjahr. Es war angesichts der steigenden Kernrenditen und der sich verschärfenden finanziellen Bedingungen ein schwieriges Jahr für die Anlageklasse.

Gegen Ende des Jahres zeigten die Märkte Anzeichen einer Erholung, die auf zwei wichtige Entwicklungen in China zurückzuführen waren: Erstens die wachstumsfördernde Haltung der Regierung, einschließlich der Wiedereröffnung der Wirtschaft und der Abkehr von der Null-COVID-Politik, und zweitens die Hinwendung zu einer für den Immobiliensektor mehr unterstützenden Politik. Die chinesischen Behörden hoben die strengen Reise- und Aktivitätsbeschränkungen im Zuge besagter Wiedereröffnung auf, was der positiven Stimmung im chinesischen Kreditkomplex entgegenkam. Was den Immobiliensektor betrifft, so haben sich die chinesischen Aufsichtsbehörden positiver zur Finanzierung von Bauträgern geäußert, und die People's Bank of China („PBoC“) und die China Banking and Insurance Commission („CBIRC“) betonten die Notwendigkeit, die Risiken für „qualitativ hochwertige und systematisch wichtige“ Bauträger zu mindern.

Inmitten der beispiellosen Volatilität auf den asiatischen Kreditmärkten war die Auswahl von Unternehmensanleihen im Jahresverlauf von entscheidender Bedeutung. Insgesamt trug die Wertpapierauswahl positiv zur relativen Rendite gegenüber dem Index bei, während die Länderallokation der größte Negativfaktor war. Die Einzeltitelauswahl in Indonesien, Indien, Hongkong, Singapur und Thailand trug maßgeblich zu den positiven Überrenditen bei. In Indien zeichnete vor allem die Übergewichtung des Portfolios im Sektor der erneuerbaren Energien für die positiven Renditen verantwortlich. Auf der anderen Seite war die Titelauswahl in China aufgrund unserer untergewichteten Positionen in Emittenten mit niedrigerem Beta in Kombination mit dem Engagement im Immobiliensektor – mit einem Rückgang des Index um 28 % im Jahr 2022 hatte der Sektor erheblich gelitten – ein Nachteil. Innerhalb der Länderallokation des Portfolios sorgte das Engagement in Sri Lanka, wo es zu einem Staatsbankrott kam, für den größten negativen Wertbeitrag.

Nach dem seit Jahrzehnten schlechtesten Jahr für asiatische Unternehmensanleihen und die Schwellenländer („EM“) im Allgemeinen sind wir der Meinung, dass die Aussichten für die Anlageklasse im Jahr 2023 viel besser sind. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in den großen asiatischen Volkswirtschaften ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, glauben wir, dass der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft möglicherweise zu einem eher zweiseitigen Risiko werden könnte. In China war die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen zwar eine Überraschung, doch könnte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums könnten im weiteren Jahresverlauf zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die gesamte Region führen. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für asiatische Hochzinsanleihen im Jahr 2023 aufgrund der positiven Entwicklungen in China sinken werden. Speziell in Bezug auf China sind wir der Ansicht, dass angesichts des Entgegenkommens der Politik gegenüber Bauträgern sowie der allgemeinen wachstumsfördernden Haltung der Regierung eine positivere Haltung nun gerechtfertigt ist. Darüber hinaus sind wir der Ansicht, dass der breitere China-Komplex, einschließlich Macau, in Zukunft von der Wiedereröffnung profitieren könnte. Wir halten das Engagement in Sri Lanka aufrecht und gehen davon aus, dass die Bewertungen nach der Erholung über den aktuellen Marktpreisen liegen werden. Andersorts bleiben wir angesichts der attraktiven Fundamentaldaten und der Bewertungen gegenüber Kreditgelegenheiten positiv, insbesondere in Süd- und Südostasien einschließlich Indien.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir zum einen in entweder einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben könnte, oder zum anderen in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen könnte. In Anbetracht der aktuellen Renditeniveaus für asiatische Hartwährungsanleihen vertreten wir die Ansicht, dass diese Risiken gut kompensiert werden. Wir halten die Bewertungen asiatischer Kredite für attraktiv.



## China A-Share Equity – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse CNY I auf -22,68 %. Der MSCI China A Onshore Net Index (Total Return, CNY) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von -20,63 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Nach der aggressiven Verschärfung der Vorschriften im Jahr 2021 erwarteten viele Marktteilnehmer, dass 2022 ein Jahr der Erholung für China werden würde, doch erwies sich das letzte Jahr dann als noch schwieriger. Chinas Festhalten an der Null-COVID-Politik und der Abschwung am chinesischen Immobilienmarkt haben zusammen mit den schwachen globalen Wachstumsraten, den Zinserhöhungen der US-Notenbank und dem Krieg zwischen Russland und der Ukraine die chinesischen Aktienmärkte sowohl in Bezug auf die Fundamentaldaten als auch auf die Liquidität geschwächt.

Im November erholte sich der Markt allerdings stark, da die chinesische Regierung ihre Null-COVID-Politik aufgab und die Quarantäne- und zwischenmenschlichen Kontaktvorschriften lockerte. (Es überrascht nicht, dass die Daten des Einkaufsmanagerindexes („PMI“) für Dezember schwächer ausfielen, da die COVID-Fälle infolge dieser Lockerungen stark anstiegen.) An der Immobilienfront leitete die Regierung eine Reihe von Maßnahmen ein, um Bauträger mit Finanzierungsproblemen zu unterstützen. Die Erholung gegen Ende des Jahres war zwar willkommen, konnte aber frühere Verluste nicht wettmachen.

Während des Berichtszeitraums legten Energiewerte deutlich zu, insbesondere Kohle und Öl, an, während alle anderen Sektoren an Wert verloren. Defensive Versorger und zinssensitive Finanzwerte verzeichneten Outperformance, während IT, Werkstoffe und das Gesundheitswesen am stärksten nachgaben.

Das Portfolio übertraf den Index während der Rally im vierten Quartal, blieb aber im Gesamtjahr hinter ihm zurück. Die Underperformance resultierte aus der Nullgewichtung von Energietiteln und der Titelauswahl in den Bereichen Nicht-Basiskonsumgüter und Kommunikationsdienste. Dieser Gegenwind überwog die Vorteile durch unsere Finanz- und Immobilien Titel sowie die Übergewichtung von Basiskonsumgütern.

Wir bleiben unserer Anlagephilosophie treu und konzentrieren uns – durch qualitativ hochwertige Unternehmen im gesamten Marktkapazitätsspektrum – weiterhin auf inländisches Wachstum. Die Arten der von uns gesuchten Unternehmen bezeichnen wir als „Quality Compounds“ und „Secular Growth Beneficiaries“.

Quality Compounds sind qualitativ hochwertige Unternehmen mit hoher Eigenkapitalrendite („ROE“), einem Potenzial für beständigen Cashflow und einer starken Unternehmensführung mit einer konsistenten langfristigen Performancebilanz. Diese konzentrieren sich auf die Konsumgüterindustrie, das Gesundheitswesen und den Finanzsektor.

Profiteure des säkularen Wachstums sind Unternehmen, die für ein langfristiges inländisches säkulares Wachstum positioniert sind und die von der Politik der Regierung und breiteren Branchentrends unterstützt werden. Diese konzentrieren sich hauptsächlich auf die Branche der alternativen Energien, einschließlich qualitativ hochwertiger Unternehmen in den Bereichen Batterien für Elektrofahrzeuge („EV“), Photovoltaikmodule und -geräte sowie Unterhaltungselektronik.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Ansicht, dass sich China definitiv auf dem Weg der Wiedereröffnung der Wirtschaft befindet. In den kommenden Monaten ist eine Rückkehr zur Normalität zu erwarten, auch wenn der derzeitige rasche Anstieg der COVID-Fälle die Wachstumsdynamik kurzfristig abschwächen wird.

Im Zuge der Wiedereröffnung des Landes dürften die am stärksten von COVID betroffenen Sektoren am meisten profitieren. Wir glauben, dass sich in den folgenden Bereichen Anlagegelegenheiten ergeben werden: Konsum, zunächst im Bereich der lebensnotwendigen und dann der nicht lebensnotwendigen Güter; Gesundheitswesen, wo sich die von der Pandemie betroffenen medizinischen Dienste wahrscheinlich erholen werden; Neue Energien, ein Bereich, der trotz kurzfristiger Hindernisse ein langfristiges, säkulares Wachstumspotenzial hat; Immobilien, wo eine Umkehr der Politik zu einer Erholung der kurzfristigen Fundamentaldaten führen könnte; Finanzwerte, ein Sektor, der wahrscheinlich von der wirtschaftlichen Erholung und einem möglichen höheren Zinsumfeld im weiteren Jahresverlauf profitieren wird sowie das Internet, wo die Kombination aus einem sich normalisierenden regulatorischen Umfeld, sich verbessernden Fundamentaldaten und dem Potenzial, dass Kapital zurück in die Schwellenländer fließt, den Sektor unterstützt.

Wir nutzen die Anlagegelegenheiten, die sich in den von uns anvisierten Bereichen bieten, um unser diversifiziertes Portfolio mit qualitativ hochwertigen Kernbeteiligungen auszubauen und langfristig attraktive risikobereinigte Renditen zu erzielen.

## China Bond – Bericht des Investment-Managers

Für die zwölf Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamterträge für Anteile der Ausschüttenden Klasse CNY I auf -6,13 %. Der als Referenzindex dienende FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Minus von 2,08 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterträge erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Gemessen am China Bond New Composite Total Return Index rentierten festverzinsliche chinesische Onshore-Anlagen im Berichtszeitraum mit 3,30 % in CNY, eine relativ starke Performance im Vergleich zu anderen globalen festverzinslichen Anlageklassen. Während die Zentralbanken weltweit gegen eine ausufernde Inflation vorgingen, indem sie die Zinssätze in einem seit der Volcker-Ära noch nie dagewesenen Tempo anhoben, hatte die chinesische Wirtschaft mit einer Reihe anderer Probleme zu kämpfen. Dazu gehörten ein schwaches Wachstum infolge der Krise am Immobilienmarkt, eine nachlassende Auslandsnachfrage und die Beibehaltung der Null-COVID-Politik. Verglichen mit den Zinssätzen in den Industrieländern waren die Zinsbewegungen in China in diesem Jahr deutlich weniger volatil.

Die 10-jährige chinesische Staatsanleihe („CGB“) wurde in der ersten Jahreshälfte in einer relativ engen Spanne von 15 bis 20 Bp gehandelt. Der Gegenwind für das Wachstum hat die Regulierungsbehörden dazu veranlasst, weitere unterstützende Maßnahmen zu ergreifen, u. a. eine Senkung des Mindestreservesatz („RRR“) um 25 Bp im April und eine Senkung des Referenzzinssatzes für 5-jährige Kredite („LPR“) im Mai. Gegen Ende des Jahres spielte der bevorstehende 20. Parteitag Mitte Oktober eine große Rolle, und die Regierung ging kein Risiko ein, d. h. sie ordnete strenge Kontrollen mit stadtweiten Lockdowns an. Dies stand im krassen Gegensatz zu den Nachbarländern, die ihre Reisebeschränkungen lockerten. In der Folge fielen die Zinssätze auf einen Tiefstand von 2,62 % und bewegten sich im dritten Quartal 2022 in einer Spanne zwischen 2,65 % und 2,75 %. Im Anschluss an die Ernennung der neuen Führungsspitze auf dem 20. Parteitag im Oktober wurden breit angelegte stimulierende Maßnahmen für den angeschlagenen Immobiliensektor ergriffen. Mit der Wiedereröffnung der Wirtschaft machten sich erste Anzeichen von Hoffnung breit, insbesondere in den offiziellen Mitteilungen und durch die Lockerung der Null-COVID-Politik durch die lokalen Behörden. Dies überraschte die Anleger und führte zu einem sprunghaften Anstieg der CGB-Renditen, die das Jahr in einer Spanne von 2,85 % bis 2,95 % beendeten.

Bei Unternehmensanleihen war in den ersten 10 Monaten des Berichtszeitraums weiterhin eine steigende Zahl von Zahlungsausfällen im Immobiliensektor zu beobachten. Vor allem Immobilienunternehmen im Privatbesitz (Privately Owned Enterprise, „POE“) waren die Leidtragenden, da Bauträger in Staatsbesitz (State-Owned Equity, „SOE“) immer noch in der Lage sind, die Regierung oder SOE um finanzielle Unterstützung zu bitten. Im vierten Quartal 2022 überraschten rasche Abverkäufe der Onshore-Zinsen und -Kredite die Anleger und resultierten in einem starken Rückgang des Nettoinventarwerts („NIW“) von Vermögensverwaltungsprodukten („WMPs“). Dies führte zu einem weit verbreiteten Rücknahmepressure auf Onshore-WMPs durch Kleinanleger. Diese negative Feedbackschleife zeigte sich im November und Dezember. Unternehmensanleihen wurden gleichermaßen nicht verschont. In den letzten beiden Monaten des Jahres 2022 kam es zu einer breiten Ausweitung der Renditen auf Unternehmensanleihen, und die Credit-Spreads weiteten sich drastisch weiter als der historische Durchschnitt.

Auf der Devisenseite erlebte der CNY im Laufe des Jahres 2022 zwei wesentliche Abwertungswellen. Die erste Welle erfolgte im April in der Folge der erwarteten Zinssenkungen in China angesichts der raschen Straffung in den Industrieländern. Die zweite Welle der raschen Abwertung ereignete sich im dritten Quartal, nachdem die People's Bank of China („PBoC“) im August angesichts der sich verschlechternden Wirtschaftsdaten die Leitzinsen erneut und unerwartet gesenkt hatte. USD/CNY erreichte einen Spitzenwert von etwa 7,35, bevor er in den letzten beiden Monaten des Berichtszeitraums aufgrund der Erwartungen auf eine Wiedereröffnung der Wirtschaft unter die Marke von 7,0 zurückfiel.

Die negative Rendite des Portfolios am Ende des Berichtszeitraums war hauptsächlich auf Beteiligungen in USD-Immobilienanleihen zurückzuführen, denn sie waren im Zuge einer Welle von Kreditereignissen in diesem Sektor einem beispiellosen Preisdruck ausgesetzt. Bei den Onshore-Anleihen hielten wir eine kurze Duration bei und positionierten uns angesichts der unattraktiven Credit-Spreads und Zinsen defensiv. Dies hat uns geholfen, den Ausverkauf – infolge des Drucks auf die Rückzahlung von WMPs – in den letzten beiden Monaten des Jahres abzufedern. Wir haben eine gewisse Allokation zu USD-Immobilienanleihen, bei denen es zu unerwarteten Zahlungsausfällen und Kreditereignissen kam. Dies verursachte in diesem Jahr den größten Teil der Performanceeinbußen. In der zweiten Jahreshälfte erhöhte der rasche Anstieg der US-Zinsen am kurzen Ende die relative Attraktivität von USD-Unternehmensanleihen mit Investment Grade („IG“), und wir haben etwa 25 % des Nettovermögens des Portfolios taktisch in starke USD-IG-Unternehmensanleihen angelegt.

Die jüngsten globalen Wirtschaftsdaten haben sich zweifelsohne verschlechtert. Eine weltweite wirtschaftliche Abschwächung könnte das schwache Wachstumsprofil Chinas noch verschärfen. Das Risiko, dass die Wirtschaft in Mitleidenschaft gezogen wird, besteht weiterhin. Die Ergebnisse des alle zwei Jahrzehnte stattfindenden Gipfeltreffens, des 20. Parteikongresses der Kommunistischen Partei Chinas („KPC“), wird wahrscheinlich große makroökonomische Auswirkungen und eine strukturelle Umverteilung der Kapitalallokation zur Folge haben. Sobald sich die politischen Wogen geglättet haben, werden wir uns auf die „Zwei Sitzungen“ im März 2023 konzentrieren, um ein besseres Gefühl dafür zu bekommen, wie die KPC die wirtschaftlichen Herausforderungen anzugehen gedenkt.

Derzeit gehen wir davon aus, dass die Stimmung am Anleihenmarkt weiterhin sehr fragil ist und sich die Abflüsse aus Anleihen (die wahrscheinlich in Aktien umgeschichtet werden) im ersten Quartal 2023 wahrscheinlich fortsetzen werden. Es wird wahrscheinlich einige Zeit dauern, bis die Abflüsse aus WMPs zu einem Ende kommen, und weiterer Verkaufsdruck könnte zu Volatilität an den Zins- und Kreditmärkten führen. Nach unseren bisherigen Erfahrungen mit Ausverkäufen ist Liquidität von größter Bedeutung. Wir werden versuchen, unsere Risikopositionen während solcher Marktverwerfungen schrittweise zu erhöhen.

## China Bond – Bericht des Investment-Managers (Fortsetzung)

Bezüglich des Immobilienmarkts glauben wir, dass die jüngsten unterstützenden Maßnahmen zur Verbesserung der Marktstimmung und zur Stabilisierung des Vertrauens der verschiedenen Interessengruppen (Investoren, Lieferanten, Hauskäufer) ein positives Signal setzen und zeigen, dass die Finanzaufsichtsbehörden eine entschlosseneren und stärkere Haltung einnehmen, um die Probleme der schleppenden Wohnungsbauprojekte anzugehen und die Refinanzierungspläne von Bauträgern einzustellen. Wir werden jedoch die Wirksamkeit dieser Maßnahmen auch in Zukunft überwachen und prüfen, inwieweit sie zu einer Verbesserung bei den Vertragsabschlüssen führen werden. Die Preise für Immobilienanleihen sind stark angestiegen, und wir sind zum jetzigen Zeitpunkt zurückhaltend. Wir warten auf Anzeichen für einen Refinanzierungskanal für POE-Titel, da dieser immer noch von der Projektbewertung und der Due-Diligence-Prüfung durch die Banken abhängt, die die Kreditlinien gewähren. Für qualitativ hochwertigere SOE/Unternehmen mit gemischten Eigentumsverhältnissen könnte ein Rückgang des Risikos eine gute Gelegenheit bieten, das Risiko in diesem Bereich schrittweise zu erhöhen.

Wir glauben außerdem, dass sich die Bereiche der Anfälligkeit von POE-Immobiliennamen auf fundamental schwache lokale staatliche Finanzierungsmechanismen („LGFVs“) und vor- und nachgelagerte Unternehmensengagements im Zusammenhang mit dem breiteren Immobilienökosystem verlagern werden. Die jüngsten Schlagzeilen über einige finanziell angespannte Regionen wie Yunnan, Guizhou und Gansu deuten an, dass die lokalen Regierungen weiterhin Ansteckungsgefahren fürchten und der Liquiditätsdruck auf schwächere LGFVs zunimmt. Wir rechnen mit einer stärkeren Differenzierung des Sektors. Aus diesem Grund werden wir uns wahrscheinlich nur bei qualitativ hochwertigen Titeln engagieren.

## China Equity – Bericht des Investment-Managers

Für die zwölf Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -21,33 %. Der als Benchmark dienende MSCI China All Shares Net Total Return Index (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von +23,61 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Die chinesischen Aktienmärkte erlebten 2022 infolge des sich abkühlenden Wirtschaftswachstums erhebliche Turbulenzen. Zu Beginn des Berichtszeitraums, aufgrund der Befürchtung einer schnelleren Straffung der US-Politik, verkauften sowohl die chinesischen Offshore- als auch die Onshore-Aktienmärkte ihre Vermögenswerte zusammen mit den globalen Risiken. Die Korrektur beschleunigte sich nach dem Russland-Ukraine-Konflikt und den umfassenden Lockdowns in einer Reihe von Großstädten, darunter Shenzhen und Shanghai, aufgrund eines lokalen Anstiegs der COVID-19-Fälle. Während sich die Märkte im Mai und Juni stabilisierten, nachdem die Regierung fiskal-, kredit- und industriepolitische Maßnahmen zur Ankurbelung des Wirtschaftswachstums angekündigt hatte, korrigierten sich die chinesischen Aktienmärkte im Laufe des Sommers. Ausschlaggebend waren dabei die erneuten Sorgen über die Kreditprobleme von Bauträgern und die mögliche Einstellung der Börsennotierung von in den USA notierten ADRs. Zu diesem Zeitpunkt waren wir der Meinung, dass das mit der Null-COVID-Politik verbundene Abwärtsrisiko bereits im Markt eingepreist war. Wir nutzten daher die Marktvolatilität, um in viele hochwertige Unternehmen zu investieren, die aufgrund der negativen Anlegerstimmung verkauft wurden. Das Portfolio war dadurch für die Markterholung am Ende des Berichtszeitraums gut positioniert, als China seinen Wiedereröffnungsprozess beschleunigte und unterstützende Maßnahmen für Bauträger einführte.

Mit Blick auf die Zukunft rechnen wir inmitten einer schnelleren Wiedereröffnung der Wirtschaft und einem unterstützenden politischen Hintergrund mit einer deutlichen Erholung des Wirtschaftswachstums. Auf der Tagung des Politbüros und Chinas zentraler wirtschaftlicher Arbeitskonferenz (Central Economic Work Conference) im Dezember wurde eine wirtschaftsfreundliche Haltung eingenommen. Sie könnte eine schnellere Rückkehr zum Trendwachstum ermöglichen, da die politischen Entscheidungsträger einen konzertierten Ansatz zur Wachstumsförderung verfolgen. Es wird erwartet, dass die Lockerung der Politik sowohl fiskalisch als auch geldpolitisch fortgesetzt wird, zumal der Prozess der Wiedereröffnung der Wirtschaft wahrscheinlich zunächst zu einigen kurzfristigen Übergangsproblemen führen wird. Das Wachstum der Infrastrukturinvestitionen dürfte ebenfalls hoch bleiben, und der Inlandsverbrauch wird sich erholen, da sich die Beschäftigungsquote mit der vollständigen Wiedereröffnung Chinas verbessert. Was die Immobilienfront anbelangt sind wir der Meinung, dass eine weitere Verbesserung der Nachfrage Lockerung und politische Unterstützung den Liquiditätsdruck der Bauträger lindern und mögliche Auswirkungen auf die Gesamtwirtschaft eindämmen könnte.

Insgesamt schätzen wir den Ausblick für Aktien aus dem Großraum China für das Jahr 2023 positiv ein. Trotz der Marktrally seit November bleiben die Bewertungen mit einem Forward-KGV von 11,2x für den Index und 11,3x für den CSI 300 im Vergleich zum MSCI World Index mit 15,2x und dem S&P 500 mit 17,5x recht attraktiv. Es könnte zu einer Korrektur der Bewertungen kommen, die durch verbesserte Fundamentaldaten und ein starkes Gewinnwachstum infolge der erwarteten wirtschaftlichen Erholung unterstützt wird. Dennoch sind wir uns möglicher Abwärtsszenarien bewusst, beispielsweise durch eine schwächere Auslandsnachfrage angesichts des globalen Rezessionsrisikos, eine unerwartet langsame Erholung des Konsums und eine mögliche Eskalation geopolitischer Risiken. Dementsprechend ermittelt das Portfolio weiterhin hochwertige Unternehmen mit guter Gewinntransparenz und starken langfristigen Wachstumsaussichten, die dem sich abzeichnenden unsicheren makroökonomischen Umfeld potenziell trotzen können.

## CLO Income – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -6,91 %. Der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 1,21 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Nachdem die Emissionen von besicherten Schuldtiteln (Collateralized Loan Obligations, „CLO“) bis zum Jahresende 2021 aufgrund der Umstellung auf SOFR für den Primärmarkt erheblich beschleunigt wurde, verlief der Beginn des Jahres 2022 zunächst ruhig, wobei die CLO-BB-Spreads zu Jahresbeginn relativ stabil im Bereich von L+600 lagen. Als Anfang bis Mitte Februar geopolitische Bedenken hinsichtlich einer möglichen russischen Invasion in der Ukraine aufkamen, weiteten sich die CLO-Schuldenspreads langsam aus, und als die Invasion Ende Februar begann, weiteten sich die Spreads von CLO-Schuldtiteln sogar noch weiter aus. Dabei kamen die CLO-BB-Spreads in den Bereich L+700. Dieser Ausweitungstrend setzte sich bis Ende März fort, als die Märkte auf den geopolitischen Konflikt und die globalen wirtschaftlichen Auswirkungen der weitreichenden Sanktionen gegen Russland in der Folge der Invasion in der Ukraine reagierten.

Bis Juli weiteten sich die Spreads von CLO-Schuldtiteln dann noch weiter aus, denn die Kombination aus (a) anhaltenden geopolitischen Bedenken und den damit verbundenen wirtschaftlichen Auswirkungen der russischen Sanktionen und (b) einer aggressiven Verschärfung der Finanzbedingungen durch die globalen Zentralbanken in ihrem Bemühen, die Rekord-Inflation einzudämmen, zu einer Ausweitung der Spreads von CLO-Schuldtiteln in den Bereich von L+1.000 führte. Im August kam es zu einer deutlichen Verengung der Spreads, da die Wirtschaftsdaten darauf hindeuteten, dass sich die Weltwirtschaft in Bezug auf das Tempo der Zinserhöhungen durch die globalen Zentralbanken einem Wendepunkt näherte, wobei sich die CLO-BB-Spreads bis in den Bereich von L+850 verengten.

Im September und Oktober weiteten sich die Spreads von CLO-Schuldtiteln erneut aus, da gemischte Wirtschaftsdaten zu anhaltenden Sorgen um erhöhte Zinssätze führten, was durch den sogenannten „Mini-Haushalt“ des Vereinigten Königreichs noch verschärft wurde, und zu erzwungenen Verkäufen von CLO-Schuldtiteln im Besitz britischer Rentenversicherungen führte. Die CLO-BB-Spreads wurden dadurch in den Bereich von L+1.050 gedrückt. Mitte November, nach der Veröffentlichung unerwartet guter US-VPI-Daten, verengten sich die Spreads von CLO-Schuldtiteln, da die Anleger den VPI-Bericht als positiven Hinweis auf eine mögliche Verlangsamung der Zinserhöhungen interpretierten. Dieser Verengungstrend setzte sich bis zum Jahresende fort, wobei die CLO-BB-Spreads zum 31. Dezember 2022 bei etwa L+950 lagen.

Zum 31. Dezember 2022 lag die nennwertgewichtete Ausfallrate für Darlehen für die vorhergehenden 12 Monate bei 0,72 % und damit um 345 Basispunkte unter dem letzten Höchststand von 4,17 % im September 2020. Trotz der Marktvolatilität war das Neuemissionsvolumen im Jahr 2022 mit 117 Mrd. USD das zweithöchste in der Geschichte und folgte auf das Volumen von 165 Mrd. USD im Jahr 2021.

In den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2022 verzeichnete der Fonds Nettozuflüsse in Höhe von 12 Mio. USD. Zum 31. Dezember 2022 lagen die primären CLO-BB-Spreads für höherwertige BBs bei L+825. Das Portfolio blieb aufgrund schwächerer Kreditbedingungen und der allgemeinen Ausweitung der Spreads von Unternehmensanleihen ohne Investment Grade im Jahresverlauf hinter dem Index zurück.

Aus fundamentaler Sicht vertrauen wir weiterhin auf die beträchtliche strukturelle Absicherung gegen Kreditverluste in den dem Portfolio zugrunde liegenden Krediten. CLO-Strukturen im Allgemeinen und CLOs mit einem BB-Rating im Besonderen haben sich gegenüber einer erheblichen Rezession einmal mehr als sehr robust erwiesen. Unser Fokus auf Anlagen in die erstklassigsten zugrunde liegenden Kredit-Portfolios wird nach unserer Überzeugung über einen mehrjährigen Anlagehorizont zu Outperformance führen.

## Commodities – Berichts des Investment-Managers

Von der Auflegung am 9. Februar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf 12,00 %. Im selben Zeitraum betrug die Rendite des als Benchmark dienenden Bloomberg Commodity Index (der „Index“) 4,89 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

2022 war für die Märkte eines der schwierigsten Jahre der jüngeren Geschichte. Ein schmerzhaftes Gemisch aus den Nebeneffekten des russischen Krieges in der Ukraine, einer unerbittlicher Inflation und der daraus resultierenden restriktiven Geldpolitik der US-Notenbank Federal Reserve Board (die „Fed“) belastete die Vermögenswerte auf breiter Front. Insbesondere der S&P 500 Index und der Bloomberg US Aggregate Bond Index erlitten im Laufe des Jahres mit einem Minus von 18,11 % bzw. 13,01 % schwere Einbrüche. Ein Lichtblick an den Märkten waren im Laufe des Jahres jedoch Rohstoffe, deren Index im Jahr 2022 um beeindruckende 16,09 % anstieg. Wie üblich konnte durch Rohstoffe neben traditionellen Vermögenswerten wie Aktien und Anleihen ein Standbein aufgebaut werden. Sie boten einen dringend benötigten Inflationsschutz.

Energierohstoffe führten das Feld im Jahresverlauf an, wobei der Bloomberg Energy Subindex im Berichtszeitraum um 15,62 % anstieg, da die Sanktionen gegen russische Ölexporte zu Lieferunterbrechungen führten. US-Erdgas, das im Sommer seine Höchstmarke erreichte und um astronomische +137 % gestiegen war, fiel schnell wieder zurück und sank im restlichen Jahresverlauf um -55,26 %. Wir glauben, dass dies den Preis näher an den Fundamentalwert heranbringt – die Erdgasexporte sind weiterhin ausgelastet, und in den USA gibt es ein reichliches Angebot, das die Argumente für die Knappheitsbedingten Preise widerlegt. Im Laufe des Jahres war die Positionierung des Portfolios im Energiebereich sowohl aus absoluter als auch aus relativer Sicht positiv. Im Vergleich zur Benchmark trug die fast zweistellige Untergewichtung des Portfolios von Erdgas am stärksten zur Outperformance bei und half dem Portfolio, den raschen Rückgang von Erdgas zum Jahresende zu vermeiden.

Industriemetalle waren im Jahresverlauf schwächer, da China, der weltweit größte Rohstoffverbraucher, aufgrund der Null-COVID-Politik der Regierung weiterhin in Lockdowns verharrte. Während des Berichtszeitraums war die Positionierung in Industriemetallen eine leichte Wertbeeinträchtigung. Im Vergleich zur Benchmark wurde die positive Performance durch die Übergewichtung des Portfolios in Nickel durch die negative Wertentwicklung einer untergewichteten Position in Zink aufgezehrt.

Edelmetalle, insbesondere Gold und Silber, blieben im bisherigen Jahresverlauf im Wesentlichen unverändert, da sich der Dollar von seinem seit Jahrzehnten höchsten Stand weiter abschwächte und die Anleger das Tempo der Zinserhöhungen der Fed einschätzten. Die Positionierung im Bereich der Edelmetalle beeinträchtigte die Gesamtleistung des Portfolios im Laufe des Jahres aufgrund der Übergewichtung von Gold und der Position in Palladium von außerhalb der Benchmark.

Agrarrohstoffe waren im Berichtszeitraum der zweitbeste Sektor, eine Folge der schlechten Erntebedingungen und des geringeren Angebots. Die Positionierung des Portfolios in der Landwirtschaft war im Vergleich zur Benchmark additiv und profitierte von einer Übergewichtung von Mais, Kansas-Weizen, Sojaschrot und Weizen.

Agrarrohstoffe waren im Jahresverlauf negativ, wobei Kaffee mit -31,58 % den stärksten Rückgang verbuchte. Aus Portfolioperspektive beeinträchtigte dieser Sektor die Performance. Das Portfolio entwickelte sich auf einer Linie mit der Benchmark, da die Gewinne aus einer Untergewichtung von Kaffee durch Verluste durch Baumwolle, bedingt durch eine Übergewichtung, ausgeglichen wurden.

Abschließend sei der Sektor Lebewidvieh erwähnt, der sich im Jahr 2022 uneinheitlich entwickelte, aber dennoch einen positiven Wertbeitrag leistete. Relativ gesehen schnitt das Portfolio aufgrund einer Übergewichtung von magerem Schweinefleisch besser ab als die Benchmark.

Aufgrund einiger politischer Weichenstellungen, die wir im allgemeinen makroökonomischen Umfeld beobachtet haben, glauben wir, dass die Märkte vor einer längeren Mangelphase stehen, wodurch ein anhaltender Superzyklus etabliert wird. Ein Superzyklus ist eine Abfolge von Preisspitzen, also kein schöner und stetiger Aufwärtstrend der Preise. Wie in den 1970er und 2000er Jahren beobachten wir im Allgemeinen eine Preisspitze nach der anderen. Da die Rohstoffmärkte Angebot und Nachfrage ausgleichen müssen, schnellen die Preise in die Höhe, wenn die Lagerbestände und Kapazitätsreserven erschöpft sind, um die Nachfrage zu senken. In diesen stark schwankenden Umgebungen puffert Carry (d. h. die Knappheitsprämie) die Spot-Verluste durch eine höhere Prolongation ab, wie wir in früheren Zyklen gesehen haben. Wir beginnen das Jahr 2023 mit einer beträchtlichen Prolongation in fast allen Rohstoffsektoren. Wir glauben, dass die Preise im Jahr 2023 sehr wahrscheinlich den strukturellen Unterinvestitionen und den durch die politischen Entscheidungen ausgelösten Nachfragetrends folgen werden. Zum jetzigen Zeitpunkt sind die Märkte jedoch sehr stark auf eine steile Rezession eingestellt. Sie sind fest in einer risikoscheuen Haltung positioniert und in keiner Weise auf die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft, eine geringere Gasbelastung der europäischen Industrie und eine unerwartet widerstandsfähigere US-Wirtschaft eingestellt.

## Corporate Hybrid Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I -14,13 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (Total Return, abgesichert, Euro) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von -13,80 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Index II aufgeführt.) Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden und sonstigen Ausschüttungen.)

Vor Abzug von Gebühren übertraf der Fonds die Benchmark im Jahr 2022 um 25 Basispunkte. Eine positive Titelauswahl unter Versorgern, in der Grundstoffindustrie und im Gesundheitswesen waren die Hauptantriebskräfte der Performance des Portfolios. Bei den Versorgern sorgten Positionen mit kurzen Laufzeiten wie Enel und Centrica sowie spezifische Situationen wie im Fall von EnBW und Veolia für Mehrwert. In der Grundstoffindustrie waren Solvay und Evonik die wichtigsten Emittenten mit Outperformance. Bei Solvay sehen wir die Aufspaltung des Spezialchemiegeschäfts immer noch als positiv an und glauben, dass die hybriden Titel nach Abschluss der Aufspaltung gut positioniert sein werden, um weiter zuzulegen. Für Evonik gilt, dass die Gruppe weiterhin ihre Fähigkeit unter Beweis stellt, den Inflationsdruck weiterzugeben und mit der nachlassenden Nachfrage fertig zu werden. Das Unternehmen ist außerdem dabei, was unseres Erachtens positiv ist, den zyklischeren Teil seines Chemiegeschäfts auszugliedern. Unsere Untergewichtung im Immobiliensektor wirkte sich ebenfalls positiv auf die Sektorallokation aus, was jedoch durch negative Renditen bei der Titelauswahl innerhalb des Sektors wieder wettgemacht wurde. Die Sektoren Transport und Energie beeinträchtigten die Performance aus Sicht der Sektorauswahl ebenfalls. Der Transportsektor ist strukturell untergewichtet, da er Emittenten aus Schwellenländern enthält, die nicht Teil unseres investierbaren Universums sind. Im Fall von Energie wirkte sich unsere Untergewichtung im Jahr 2022 negativ aus, da die hohen Rohstoffpreise den Emittenten hier zu einer relativ guten Performance verhalfen.

Unsere Durationspositionierung im Verlauf von 2022 leistete ebenfalls einen erheblichen Wertbeitrag. Im Durchschnitt war unsere Duration gegenüber dem Index im gesamten Jahr 0,3 Jahre kürzer. Dies war meistens das Ergebnis der Ermittlung attraktiver, unterbewerteter kurzfristiger hybrider Instrumente für das Portfolio. Wir behalten unsere Durationspositionierung insgesamt im Auge, bauen das Portfolio aber immer auf einer Bottom-up-Basis und Einzelwertpapierbasis auf. Dies bedeutet, dass wir auch währungsneutral und bereit sind, das mit einer bestimmten Währung verbundene Zinsrisiko einzugehen, wenn wir die Anleihe in dieser Währung für am stärksten unterbewertet halten.

Wir bleiben der Nullgewichtung von Emittenten aus Schwellenländern verpflichtet und haben ein begrenztes Engagement in Anleihen, die von Emittenten aus der peripheren Eurozone begeben werden. In Fluggesellschaften, Hotels, Reise- oder Freizeitunternehmen ist das Portfolio weiterhin gar nicht engagiert. Die meisten Emittenten von Hybridanleihen in unserem Bestand sind unseres Erachtens äußerst robust und zeichnen sich durch begrenzte fundamentale Sensitivität gegenüber dem Wirtschaftsausblick oder den Ölpreisen aus.

Angesichts der weiteren Spreads bei hybriden Unternehmensanleihen im Jahresverlauf blieb der Spreadunterschied zwischen interpolierten Senior Spreads und ihren Pendants bei hybriden Unternehmensanleihen mit durchschnittlich +325 Bp weiterhin erhöht. Wir gehen nach wie vor davon aus, dass das relative Niveau der Senior Spreads hochwertiger europäischer Nichtfinanzunternehmen mit Investment Grade („IG“) und das anhaltend niedrige Renditeniveau von Staatsanleihen – vor allem auf Euro lautenden – die Spreads von Hybridanleihen weiter stützen sollten und diese im Vergleich zu anderen Optionen auf den europäischen Kredit- und den breiteren Rentenmärkten attraktiv erscheinen lassen.

Zum Ende des Berichtszeitraums blieb das Portfolio weiterhin deutlich stärker diversifiziert als der Index, vor allem auf Einzeltitelebene. Gemäß einem langfristigen Value-Ansatz haben wir jedoch weiterhin einen erheblichen Teil der Portfolioallokationen in den Sektoren Versorger, Telekommunikation und qualitativ hochwertige Energieunternehmen investiert. Unsere Entscheidungen zu Anleihekäufen erfolgten auf individueller Basis nach Bewertungen, die im Zusammenhang mit einem insgesamt niedrigen Geschäftsrisiko, geringen Schwankungen der Gewinne vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA) und, für Versorgungswerte – einem vorteilhaften regulatorischen Umfeld beurteilt werden.

Die konservative Positionierung bedeutet, dass das Portfolio (zum 31. Dezember 2022):

- ist nur in Emittenten mit Investment Grade investiert
- etwa 14 % in Wertpapieren unter Investment Grade, die von IG-Emittenten begeben wurden (alle mit BB oder BB+ geratet)
- einen Liquiditätsanteil von ungefähr 5 % hielt
- kein Engagement in Hotels, Freizeit-, Luftverkehr- oder Reiseunternehmen hatte
- bei Immobilienunternehmen Vorsicht walten ließ – denn diese erachten wir verglichen mit den meisten anderen Unternehmen im Sektor für konjunkturabhängiger

Das Portfolio investiert ausschließlich in Hybridanleihen von Nichtfinanzunternehmen. Es engagiert sich nicht in Anleihen von Banken oder anderen Emittenten aus dem Finanzsektor. Da sie weitestgehend eine erstklassige, europäisch dominierte Anlageklasse der Industrieländer mit dem Euro als Hauptwährung ist, bieten hybride Unternehmensanleihen globalen Anleiheanlegern eine gute Streuung außerhalb von Anleihen des Finanzsektors, von US-Emittenten und dem US-Dollar-Kreditrisiko.

In Bezug auf den Portfolioaufbau hat das Portfolio eine Reihe von Emittenten gekauft, mit denen die Portfoliomanager aus fundamentaler Sicht zufrieden sind. Wir haben kein Engagement in Unternehmen aus Griechenland, und das Portfolio hält keine Anleihen von Emittenten mit Sitz in einem Schwellenland. Das Portfolio weist starke Fundamentaldaten sowohl in Branchen als auch bei Emittenten auf. Die Anlagephilosophie bleibt auf langfristige, wertbasierte Anlagen ausgerichtet – der Schwerpunkt liegt auf Bottom-up-Fundamentalresearch und gründlichen Bewertungstätigkeiten. Wir warten geduldig auf Chancen, sind aber offensiv wenn wir sie finden, um zu versuchen, eine gute langfristige Wertentwicklung zu erzielen.

## Corporate Hybrid Bond – Bericht des Investment-Managers (Fortsetzung)

Wir glauben nach wie vor, dass der Markt für hybride Unternehmensanleihen weit entfernt vom fairen Wert gehandelt wird. Unseres Erachtens gibt es aus Sicht des relativen Werts verschiedene attraktive Ideen für die Einzeltitelauswahl, und das Wachstum des Neuemissionsmarkts bietet weitere Gelegenheiten in Bezug auf Diversifizierung und relativen Wert.

Wir sind überzeugt, dass die Kombination aus einer erhöhten Anfangsrendite, Spread-Verengung, Chancen bei der Einzeltitelauswahl und Neuemissionen zu attraktiven Kursen mit der Zeit zu einem positiven Ergebnis für Anleger führen sollte.



## Emerging Market Debt - Hard Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -18,98 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Minus von 17,78 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Dies war eine äußerst turbulente Zeit für Schwellenländer („EM“), die mit den anhaltenden Risiken durch COVID-19 – insbesondere China, wo die Behörden den größten Teil des Jahres an einer rigiden Politik festhielten – mit Russlands Einmarsch in der Ukraine, mit einer hartnäckig hohen Inflation, die zur aggressivsten Straffung der Geldpolitik seit Jahrzehnten führte, und mit einem stärkeren Dollar konfrontiert waren. Infolgedessen kam es zu einem starken Anstieg der Kernzinsen und den zweitschlechtesten jährlichen Renditen für die Benchmark seit ihrer Einführung im Jahr 1994. Dieser Druck auf die Märkte ging gegen Ende des Jahres zurück, da der nachlassende Preisdruck in den USA und der Eurozone das Thema der Rekordinflation unterstützte. Anzeichen dafür, dass China von seiner Null-COVID-Strategie abrückt, waren ebenfalls unterstützend. Die Indexausfallquote erreichte 7,3 %, da Weißrussland, Russland, Sri Lanka und die Ukraine ihre Auslandsverbindlichkeiten nicht mehr bedienen konnten, während Ghana ebenfalls seine Absicht kundtat, dem zu folgen. Die Unterstützung durch den IWF blieb ein wichtiges Thema für mehrere Schwellenländer wie Argentinien, Ägypten und Pakistan sowie ein Anker für die laufenden Umstrukturierungsprozesse in Ghana, Sri Lanka und Sambia.

Die Index-Spreads weiteten sich von 369 Basispunkten auf 453 Basispunkte und erreichten Mitte Juli einen Höchststand von 593, während die Renditen auf US-Staatsanleihen das Jahr bei 3,87 % gegenüber 1,51 % zu Jahresbeginn beendeten. Die Indexrendite bis zur Fälligkeit lag Ende 2022 bei 8,56 %, gegenüber 5,29 % Ende 2021.

Die beste Performance verbuchte der Irak, unterstützt durch die hohen Ölpreise, und Costa Rica ab, wo die fiskalischen und externen Risiken durch die kontinuierliche Einhaltung des IWF-Programms gemildert wurden. Am schlechtesten schnitt die Ukraine angesichts der schrecklichen wirtschaftlichen Verwüstung durch die russische Aggression ab, gefolgt von Pakistan, dessen Finanzierungsprobleme durch erhebliche Überschwemmungen noch verstärkt wurden.

Das Portfolio schnitt schlechter ab als der Index, wofür hauptsächlich die Top-down-Positionierung und die Länderallokation maßgeblich waren, während die Einzeltitelauswahl einen positiven Wertbeitrag generierte. Bei der Länderallokation wirkten sich primär unsere Übergewichtung der Ukraine, von Sri Lanka und Ghana sowie unsere Untergewichtung der Türkei aus, wo die Behörden zur Deckung des Finanzierungsbedarfs auf lokale und bilaterale Quellen zurückgreifen konnten. Unsere Untergewichtung von Russland und die Abwesenheit von Pakistan und Weißrussland trugen am meisten zur Performance bei. Unsere Positionierung bei quasistaatlichen Titeln in Kasachstan war durch die Wertpapierauswahl der Hauptfaktor für Wertabzüge.

Wir glauben, dass die Aussichten für die Anlageklasse im Jahr 2023 deutlich besser aussehen. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in den vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft zu einem eher zweiseitigen Risiko werden könnte. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen. Wir denken, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

Unserer Meinung nach sind die technischen Daten günstig, da die Mittelzuflüsse in die Anlageklasse nach den beträchtlichen Abflüssen im vergangenen Jahr wieder anlaufen und die Nettoemissionen negativ bleiben, insbesondere in den Märkten für höher verzinsliche Wertpapiere. Wir sind der Ansicht, dass die Spread-Ausweitung bei Hartwährungsanleihen aus Schwellenländern in diesem Jahr unverhältnismäßig hoch war, vorrangig bei Hochzinsanleihen, und wir halten die Bewertungen derzeit auf absoluter Basis für attraktiv.

## Emerging Market Debt - Local Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -12,92 %. Der JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht abgesichert, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -11,69 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Dies war eine äußerst turbulente Zeit für Schwellenländer („EM“), die mit den anhaltenden Risiken durch COVID-19 – insbesondere in China, wo die Behörden den größten Teil des Jahres an einer rigiden Politik festhielten – in Kombination mit Russlands Einmarsch in der Ukraine, mit einer hartnäckig hohen Inflation, die zur aggressivsten Straffung der Geldpolitik seit Jahrzehnten führte, und mit einem stärkeren Dollar konfrontiert waren. Vor diesem schwierigen Hintergrund stieg die durchschnittliche Rendite des auf Lokalwährungen lautenden Schwellenländerindex deutlich von 5,72 % zu Jahresbeginn auf 6,86 % Ende Dezember, während Schwellenländerwährungen im selben Zeitraum durchschnittlich um 6,14 % gegenüber dem US-Dollar nachgaben.

Die Türkei war im Jahr 2022 das Land mit der besten Performance im Lokalwährungsindex. Zu danken war dabei dem Rückgang der lokalen Renditen aufgrund eines Lockerungszyklus und einer Politik, die auf verstärkte Anleihenkäufe durch inländische Institutionen ausgerichtet war. Es folgten Brasilien und Uruguay, die im vergangenen Jahr jeweils zweistellige positive Renditen verzeichneten. Neben russischen Anleihen, die nach der Invasion in der Ukraine einbrachen und Ende März aus dem Index genommen wurden, war Ägypten das Indexland mit der schlechtesten Performance, eine Folge der beiden starken Abwertungen des ägyptischen Pfunds im März und im Oktober, gefolgt von Ungarn und Kolumbien.

Das Portfolio blieb im Berichtszeitraum hinter dem Index zurück, was hauptsächlich an der Zinspositionierung lag. Zu den größten Negativbeiträgen bei Zinsen zählten die Übergewichtete Duration in Brasilien, Mexiko und Ungarn sowie die zum Jahresende untergewichtete Position in Chile. Im Devisenbereich kamen die größten Wertabzüge vor allem durch Engagements außerhalb der Benchmark im kasachischen Tenge und ghanaischen Cedi sowie eine Positionierung im chilenischen Peso zustande. Positiv wirkten sich in diesem Zeitraum vor allem die Untergewichtung des ägyptischen Pfunds und des chinesischen Renminbi, die Übergewichtung des südafrikanischen Rand sowie die Untergewichtung der Duration in Polen und Thailand aus. Die Positionierung in Russland trug ebenfalls zur relativen Performance bei, da wir uns nach der Invasion schrittweise aus allen russischen Beteiligungen zu allgemein besseren Preisen als zum Zeitpunkt des Indexausschlusses zurückzogen.

Nach dem starken Rückgang festverzinslicher EM-Wertpapiere im vergangenen Jahr sind die Aussichten für diese Anlageklasse im Jahr 2023 unserer Meinung nach positiver. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft zu einem eher zweiseitigen Risiko werden. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen.

Auch die technischen Daten haben sich verbessert, da die Kapitalströme aus den Schwellenländern Anzeichen aufweisen, eine Talsohle erreicht zu haben, während die Bewertungen in verschiedenen Märkten für Schwellenländerzinsen und -devisen weiterhin recht attraktiv sind. Vor diesem Hintergrund sind wir zu einer Übergewichtung der Währungen von Schwellenländern übergegangen und haben die Duration erhöht, wobei wir die lateinamerikanische Region und eine Reihe von CEEMEA-Ländern bevorzugen, während wir uns in Asien auf den relativen Wert konzentrieren.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Risikoprämie für Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Emerging Market Debt Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -14,12 %. Der als Benchmark dienende Index, eine gewichtete Mischung aus 50 % JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht abgesichert, USD), 25 % JPMorgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25 % JPMorgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum -13,51 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Dies war eine äußerst turbulente Zeit für Schwellenländer („EM“), die mit den anhaltenden Risiken durch COVID-19 – insbesondere in China, wo die Behörden den größten Teil des Jahres an einer rigiden Politik festhielten – in Kombination mit Russlands Einmarsch in der Ukraine, mit einer hartnäckig hohen Inflation, die zur aggressivsten Straffung der Geldpolitik seit Jahrzehnten führte, und mit einem stärkeren Dollar konfrontiert waren. So kam es zu einem starken Anstieg der Leitzinsen und dem schlechtesten Performancejahr für den EMBI Global Diversified Index seit der globalen Finanzkrise. Die lokalen Schwellenmärkte beendeten das Jahr ebenfalls im Minus, was auf steigende Zinsen in verschiedenen Schwellenländern und eine Währungsschwäche gegenüber dem Dollar zurückzuführen ist. Dieser Druck auf die Märkte ging gegen Ende des Jahres zurück, da der nachlassende Preisdruck in den USA und der Eurozone das Thema der Rekordinflation unterstützte. Hilfreich wirkten sich zudem die Anzeichen aus, dass China von seiner Null-COVID-Strategie abrückt und einige konkrete Schritte zur Unterstützung des zusammengebrochenen Immobiliensektors unternimmt. Die Ausfallquote für Staatsanleihen in Hartwährung 7,3 %, da Weißrussland, Russland, Sri Lanka und die Ukraine ihre Auslandsverbindlichkeiten nicht mehr bedienen konnten, während Ghana ebenfalls seine Absicht kundtat, dem zu folgen. Die Unterstützung durch den IWF blieb ein wichtiges Thema für mehrere Schwellenländer wie Argentinien, Ägypten und Pakistan sowie ein Anker für die laufenden Umstrukturierungsprozesse in Ghana, Sri Lanka und Sambia. Die Ausfallquote bei Hochzins-Unternehmensanleihen erreichte 14,0 %, da Unternehmen in Russland, der Ukraine und dem chinesischen Immobiliensektor im Laufe des Jahres mit erheblichem Gegenwind zu kämpfen hatten.

Die Performance am Ende des zwölfmonatszeitraums war negativ, und das Portfolio blieb hinter dem Index zurück. Der Wertbeitrag aus der taktischen Allokation war im Berichtszeitraum negativ. Die zugrunde liegenden Unternehmensanleihen in Hartwährung und die Bottom-up-Positionierung in lokaler Währung trugen zur relativen Performance bei. Im Overlay war die kurze US-Zinsdurationsposition positiv. Eine CDX.EM-Position – wir hielten sie als Teilschutz gegen das höhere Risikoprofil der Strategie – war jedoch angesichts der starken Rally zum Jahresende negativ. Die Asset-Allokation war aufgrund der Übergewichtung von Staatsanleihen in Hartwährung gegenüber Lokalwährungen negativ.

Die Performance von Staatsanleihen in Hartwährung wurde hauptsächlich durch die Länderallokation dominiert, und die Titelauswahl war positiv. Bei der Länderallokation trugen unsere Untergewichtung von Russland und die Abwesenheit von Pakistan und Weißrussland am meisten zur Performance bei. Unsere Übergewichtung der Ukraine, von Sri Lanka und Sambia sowie unsere Untergewichtung der Türkei, wo die Behörden zur Deckung des Finanzierungsbedarfs auf lokale und bilaterale Quellen zurückgreifen konnten, war allerdings negativ. Unsere Titelauswahl in Argentinien war positiv, während die Positionierung in der Elfenbeinküste und die Positionierung in quasistaatlichen Anleihen in Kasachstan für die meisten Wertabzüge verantwortlich zeichneten.

Bei Unternehmensanleihen war die Positionierung in Russland der Haupttreiber für die Outperformance, insbesondere die fehlenden Positionen in der VTB Bank oder der Sberbank, deren Kurse einher mit allen russischen Unternehmensanleihen unabhängig vom Sektor nach dem Einmarsch in die Ukraine und den in Bezug auf das Land erhobenen Sanktionen deutlich fielen. Die Wertpapierauswahl in China beeinträchtigte jedoch aufgrund des Engagements im Immobiliensektor, der erheblichem Druck ausgesetzt war, was zu aktuellen Ausfällen führte. Eine Position in einem chilenischen Telekommunikationsunternehmen war ebenfalls nachteilig, da das Unternehmen während einer Fusion gegen Ende des Jahres unter Betriebs- und Liquiditätsdruck kam. Im Rahmen der Länderallokation war das übergewichtete Engagement in Brasilien positiv, da das Land seine Wahl ohne größere Unruhen über die Bühne brachte. Negativ waren die Übergewichtung der Ukraine und die Untergewichtung der Türkei und asiatischer Länder mit Investment-Grade-Rating.

Bei Lokalwährungen trug die Devisenpositionierung zur relativen Performance bei. Dies war in erster Linie auf das Engagement in Russland zurückzuführen, wo wir uns im Laufe des Jahres schrittweise aus allen Beteiligungen zurückzogen haben. Dadurch konnten wir bessere Preise erzielen als zum Zeitpunkt des Indexausschlusses. Die untergewichtete Positionierung in Polen und der Türkei waren ebenfalls positiv. Andererseits wirkte sich die übergewichtete Positionierung in Brasilien, wo ein länger als erwarteter Zinserhöhungszyklus und höhere fiskalische Risiken die Renditen in die Höhe trieben, negativ auf die Wertentwicklung aus. Schließlich wirkte sich auch unsere Untergewichtung in Chile negativ aus, da die Märkte unerwartet aggressivere Zinssenkungen einpreisten. Die Währungspositionierung war im Jahresverlauf positiv, da das Portfolio von der Untergewichtung des chinesischen Renminbi, der aktiven Positionierung im ägyptischen Pfund und der Übergewichtung des mexikanischen Peso profitierte. Eine übergewichtete Positionierung im chilenischen Peso sowie ein Engagement außerhalb der Benchmark im kasachischen Tenge und ghanaischen Pfund wirkten sich im Jahresverlauf negativ aus.

Wir glauben, dass die Aussichten für die Anlageklasse im Jahr 2023 deutlich besser aussehen. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in den vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft zu einem eher zweiseitigen Risiko werden könnte. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Bei EM-Hochzins-Unternehmensanleihen erwarten wir für 2023 einen Rückgang der Ausfallraten auf 5,2 %, wobei die meisten Ausfälle chinesische Immobilienentwickler und ukrainische Emittenten betreffen werden. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen erwarten wir, dass die Ausfallquote bei hochverzinslichen EM-Unternehmensanleihen mit 3,3 % weitgehend dem historischen Durchschnitt entsprechen wird, da EM-Unternehmen im Durchschnitt über robuste Bilanzen verfügen.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -14,33 %. Im selben Zeitraum verbuchte die zusammengesetzte Benchmark – ein Drittel JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht abgesichert, USD) und zwei Drittel JPMorgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) (der „Index“) – ein Minus von 17,86 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

Dies war eine äußerst turbulente Zeit für Schwellenländer („EM“), die mit den anhaltenden Risiken durch COVID-19 – insbesondere in China, wo die Behörden den größten Teil des Jahres an einer rigiden Politik festhielten – in Kombination mit Russlands Einmarsch in der Ukraine, mit einer hartnäckig hohen Inflation, die zur aggressivsten Straffung der Geldpolitik seit Jahrzehnten führte, und mit einem stärkeren Dollar konfrontiert waren. So kam es zu einem starken Anstieg der Leitzinsen und dem schlechtesten Performancejahr für den EMBI Global Diversified Index seit der globalen Finanzkrise. Die lokalen Schwellenmärkte beendeten das Jahr ebenfalls im Minus, was auf steigende Zinsen in verschiedenen Schwellenländern und eine Währungsschwäche gegenüber dem Dollar zurückzuführen ist. Dieser Druck auf die Märkte ging gegen Ende des Jahres zurück, da der nachlassende Preisdruck in den USA und der Eurozone das Thema der Rekordinflation unterstützte. Hilfreich wirkten sich zudem die Anzeichen aus, dass China von seiner Null-COVID-Strategie abrückt und einige konkrete Schritte zur Unterstützung des zusammengebrochenen Immobiliensektors unternimmt. Die Ausfallquote für Staatsanleihen in Hartwährung 7,3 %, da Weißrussland, Russland, Sri Lanka und die Ukraine ihre Auslandsverbindlichkeiten nicht mehr bedienen konnten, während Ghana ebenfalls seine Absicht kundtat, dem zu folgen. Die Unterstützung durch den IWF blieb ein wichtiges Thema für mehrere Schwellenländer wie Argentinien, Ägypten und Pakistan sowie ein Anker für die laufenden Umstrukturierungsprozesse in Ghana, Sri Lanka und Sambia. Die Ausfallquote bei Hochzins-Unternehmensanleihen erreichte 14,0 %, da Unternehmen in Russland, der Ukraine und dem chinesischen Immobiliensektor im Laufe des Jahres mit erheblichem Gegenwind zu kämpfen hatten.

Die Performance am Ende des zwölfmonatigen Berichtszeitraums war negativ, aber das Portfolio übertraf den Index. Die Auswirkungen der Asset-Allokation waren positiv: Der negative Effekt von der Übergewichtung von auf Hartwährungen lautenden Staatsanleihen wurde durch die Untergewichtung von Lokalwährungen zugunsten von Barmitteln kompensiert, da die lokale Indexperformance negativ war. Darüber hinaus war die kurze Zinsdurationsposition positiv.

Aus Bottom-up-Perspektive war der Haupttreiber des Portfolios im Berichtszeitraum die Nullgewichtung von Russland in Hart- und Lokalwährungen im Vorfeld und während der Invasion. Wir waren dort aufgrund von ESG-Bedenken nicht investiert. Außerhalb Russlands profitierte das Portfolio im Hartwährungssegment von seiner Übergewichtung von Chile, Indonesien und Mexiko. Die Untergewichtung von Saudi-Arabien aufgrund von ESG-Bedenken beeinträchtigte das Portfolio ebenso wie die Untergewichtung der Vereinigten Arabischen Emirate und von Malaysia. Im Lokalwährungssegment war die Durationspositionierung der Haupttreiber der relativen Outperformance. Neben Russland generierten in diesem Zeitraum vor allem untergewichtete Durationsengagements in Polen und Thailand einen positiven Wertbeitrag. Bei Devisen waren die Untergewichtung des chinesischen Renminbi und die Übergewichtung des mexikanischen Peso positiv. Die größten Abzüge von der Performance ergaben sich durch die übergewichtete Duration in Ungarn und die Untergewichtung in Chile; negativ waren auch die Engagements in Währungen von außerhalb der Benchmark in Kasachstan und Israel.

Wir glauben, dass die Aussichten für die Anlageklasse im Jahr 2023 deutlich besser aussehen. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in den vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft zu einem eher zweiseitigen Risiko werden könnte. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

## Emerging Markets Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -23,86 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von -20,09 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Aktien aus Schwellenländer („EM“) schlossen das Jahr 2022 positiv ab und verzeichneten im vierten Quartal einen soliden Gewinn. Im Gesamtjahr waren sie jedoch insgesamt rückläufig und hinkten mit einem Verlust von 20 % leicht hinter den entwickelten Märkten hinterher.

Die Besorgnis über die weltweite Inflation und steigende US-Zinsen sowie die Abschreibung des russischen Marktes, der aus dem Index herausgenommen wurde, waren in diesem Jahr die einflussreichsten Faktoren. Die Rally im vierten Quartal war eine Reaktion auf den Optimismus bezüglich einer Reihe von Bedenken, insbesondere die Abkehr Chinas von seiner Null-COVID-Politik und die Hoffnung, dass die US-Notenbank kurz vor dem Erreichen ihres höchsten Zinssatzes steht. Diese Hoffnungen wurden gegen Jahresende allerdings etwas gedämpft, als die Anleger sich über eine allgemeine Konjunkturabschwächung sorgten und was zu einer anhaltenden Abschwächung der Energierohstoffe führte.

Alle Sektoren verloren in diesem Jahr an Wert, wobei defensive Versorger und Basiskonsumgüter sowie zinsensitive Finanzwerte Outperformance erzielten und Informationstechnologie („IT“), Kommunikationsdienste und Energie am stärksten nachgaben. Nach Ländern schnitten die Türkei, Chile und Brasilien mit Outperformance für das Jahr ab. Abgesehen von der Abschreibung Russland waren Ungarn, Taiwan und Korea die Nachzügler.

Das Portfolio blieb im Jahresverlauf hinter seiner Benchmark zurück. Nach Ländern kreierte das Engagement am russischen Markt und die schlechte Aktienauswahl in Brasilien die wichtigsten Gegenwinde. Diese waren von größerer Bedeutung als unsere Übergewichtung von und starke Titelauswahl in Indien und Chile.

Nach Sektoren wirkte sich eine Übergewichtung des hinterherhinkenden IT-Sektors zusammen mit einer schwachen Positionierung negativ auf die relative Rendite aus. Gleiches gilt für russische Namen im Energiesektor. Das solide Stock-Picking bei Basiskonsumgütern und im Gesundheitswesen konnte die Defizite in anderen Bereichen nicht ausgleichen.

Mit Blick auf die Zukunft konzentrierte sich der Nachrichtenfluss im vierten Quartal hauptsächlich auf die US-Zinsen und die Aussichten für die chinesische Wirtschaft. Sie beide scheinen mittelfristig einen sichereren Verlauf zu haben, d. h. die US-Zinsen haben sich möglicherweise einem Höchststand angenähert und die chinesische Wirtschaft öffnet sich wieder. Das Team ist der Ansicht, dass der Weg möglicherweise nicht so klar ist, wie die Anleger zu glauben scheinen, denn die Entwicklungen im Dezember dämpften die Erwartungen an beiden Fronten.

Das Team nutzte die Preisvolatilität, um das inländische Engagement in China schrittweise aufzustocken, so dass das China-Engagement unter Einbeziehung unseres Engagements außerhalb der Benchmark in Hongkong einbezogen wird nahe der Benchmarkgewichtung lag. Gleichzeitig verringerte das Team seine Übergewichtung in Indien. Die Übergewichtung des Portfolios wird durch ein geringeres Engagement in einer Reihe von kleineren Märkten finanziert.

Nach Sektoren bevorzugt das Portfolio weiterhin Basiskonsumgüter und verringerte die Übergewichtung im IT-Bereich. Die Reduzierungen zum einen nach Ländern und zum anderen nach Sektoren spiegeln das Erreichen von kurzfristigen Kurszielen bei einzelnen Titeln oder die nachlassende Überzeugung von bestimmten Positionen wider.

Sowohl während der Rally im November als auch während des Rückgangs im Dezember schnitten Schwellenländer besser ab als Industrieländer. Wir glauben, dass dies ein Muster auch für 2023 sein könnte, sollte sich die US-Wirtschaft aufgrund höherer Zinssätze verlangsamen, während die Wiedereröffnung der Wirtschaft China und verbundene Märkte ankurbelt und inländisch geprägte EM-Märkte wie Indien von der nachlassenden Inflation und dem anhaltenden lokalen Wachstum profitieren.

Wir werden weiterhin jede kurzfristige Volatilität zur Feinabstimmung des Portfolios nutzen, glauben aber, dass es für das von uns erwartete Umfeld gut aufgestellt ist.

## Emerging Markets Select Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -25,02 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von -20,09 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Aktien aus Schwellenländer („EM“) schlossen das Jahr 2022 positiv ab und verzeichneten im vierten Quartal einen soliden Gewinn. Im Gesamtjahr waren sie jedoch insgesamt rückläufig und hinkten mit einem Verlust von 20 % hinter den entwickelten Märkten hinterher.

Die Besorgnis über die weltweite Inflation und steigende US-Zinsen sowie die Abschreibung des russischen Marktes, der aus dem Index herausgenommen wurde, waren in diesem Jahr die einflussreichsten Faktoren. Die Rally im vierten Quartal war eine Reaktion auf den Optimismus bezüglich einer Reihe von Bedenken, insbesondere die Abkehr Chinas von seiner Null-COVID-Politik und die Hoffnung, dass die US-Notenbank kurz vor dem Erreichen ihres höchsten Zinssatzes steht. Diese Hoffnungen wurden gegen Jahresende allerdings etwas gedämpft, als die Anleger sich über eine allgemeine Konjunkturabschwächung sorgten und was zu einer anhaltenden Abschwächung der Energierohstoffe führte.

Alle Sektoren verloren in diesem Jahr an Wert, wobei defensive Versorger und Basiskonsumgüter sowie zinsensensitive Finanzwerte Outperformance erzielten und Informationstechnologie („IT“), Kommunikationsdienste und Energie am stärksten nachgaben. Nach Ländern schnitten die Türkei, Chile und Brasilien mit Outperformance für das Jahr ab. Abgesehen von der Abschreibung Russland blieben auch Ungarn, Taiwan und Korea zurück.

Das Portfolio blieb im Jahresverlauf hinter seiner Benchmark zurück. Nach Ländern kreierte das Engagement am russischen Markt und die schlechte Aktienauswahl in Brasilien die wichtigsten Gegenwinde. Diese waren von größerer Bedeutung als unsere Übergewichtung von und starke Titelauswahl in Indien und Chile.

Nach Sektoren wirkte sich eine Übergewichtung des hinterherhinkenden IT-Sektors zusammen mit einer schwachen Positionierung negativ auf die relative Rendite aus. Gleiches gilt für Industrierwerte und die Energiesektoren. Das solide Stock-Picking bei Nicht-Basiskonsumgütern, Konsumgütern und unter Finanzwerten konnte die Defizite in anderen Bereichen nicht ausgleichen.

Mit Blick auf die Zukunft konzentrierte sich der Nachrichtenfluss im vierten Quartal hauptsächlich auf die US-Zinsen und die Aussichten für die chinesische Wirtschaft. Sie beide scheinen mittelfristig einen sichereren Verlauf zu haben, d. h. die US-Zinsen haben sich möglicherweise einem Höchststand angenähert und die chinesische Wirtschaft öffnet sich wieder. Das Team ist allerdings der Ansicht, dass der Weg möglicherweise nicht so klar ist, wie die Anleger zu glauben scheinen, denn die Entwicklungen im Dezember dämpften die Erwartungen an beiden Fronten.

Das Team nutzte die Preisvolatilität, um das inländische Engagement in China schrittweise aufzustocken, so dass das China-Engagement unter Einbeziehung unseres Engagements außerhalb der Benchmark in Hongkong einbezogen wird nahe der Benchmarkgewichtung lag. Gleichzeitig verringerte das Team seine Übergewichtung in Indien. Die Übergewichtung des Portfolios wird durch ein geringeres Engagement in einer Reihe von kleineren Märkten finanziert.

Nach Sektoren bevorzugt das Portfolio weiterhin Basiskonsumgüter und verringerte die Übergewichtung im IT-Bereich. Die Reduzierungen zum einen nach Ländern und zum anderen nach Sektoren spiegeln das Erreichen von kurzfristigen Kurszielen bei einzelnen Titeln oder die nachlassende Überzeugung von bestimmten Positionen wider.

Sowohl während der Rally im November als auch während des Rückgangs im Dezember schnitten Schwellenländer besser ab als Industrieländer. Wir glauben, dass dies ein Muster auch für 2023 sein könnte, sollte sich die US-Wirtschaft aufgrund höherer Zinssätze verlangsamen, während die Wiedereröffnung der Wirtschaft China und verbundene Märkte ankurbelt und inländisch geprägte EM-Märkte wie Indien von der nachlassenden Inflation und dem anhaltenden lokalen Wachstum profitieren.

Wir werden weiterhin jede kurzfristige Volatilität zur Feinabstimmung des Portfolios nutzen, glauben aber, dass es für das von uns erwartete Umfeld gut aufgestellt ist.

## Euro Bond Absolute Return – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I auf -4,71 %. Die Benchmark, der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der „Index“), verzeichnete im selben Zeitraum ein Minus von -0,94 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

In der ersten Hälfte des Berichtszeitraums kam es im Zuge steigender Inflationsraten zu einem starken Rückgang am Euro-Rentenmarkt. Die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen stieg deutlich von -0,18 % auf +1,33 %, ihren höchsten Stand seit 2014. Dies markiert den Datenpunkt des schnellsten Preisanstiegs seit den 1970er Jahren, hauptsächlich bedingt durch höhere Rohstoffpreise infolge Russlands Einmarsch in die Ukraine sowie durch Lebensmittelpreise als zweite Runde der Folgen höherer Energiepreise und des Rückgangs der Exporte osteuropäischer Länder, da sowohl Russland als auch die Ukraine wichtige Exporteure von Agrarprodukten und Düngemitteln sind. Darüber hinaus gab es infolge chinesischer Lockdown-Beschränkungen weiterhin Lieferkettenstörungen. Folglich erreichte der langfristige Inflationsausblick des Markts ein Hoch von 2,5 % und veranlasste die Europäische Zentralbank („EZB“) zur Frage, ob die Inflation langfristig noch verankert ist. Tatsächlich sind die Inflationsdaten für den Euro das ganze Jahr über gestiegen: Die VPI-Inflation in Deutschland verzeichnete im März einen starken monatlichen Anstieg von 2,5 %, den höchsten seit der Wiedervereinigung im Jahr 1992. Dadurch lag der Anstieg im Jahresvergleich über 7 %, was vor allem auf die höheren Energiepreise zurückzuführen ist.

Als die EZB den Lohnanstieg in der Eurozone im ersten Quartal 2022 veröffentlichte, stieg dieser Indikator für die ausgehandelten Löhne von 1,8 % im vierten Quartal 2021 auf 2,8 % im ersten Quartal 2022. Dies war allerdings teilweise auf tarifliche Einmalzahlungen wie in der Chemiebranche in Deutschland zurückzuführen, die zum Teil das Ergebnis verzögerter Lohnverhandlungsrunden aufgrund des Krieges in der Ukraine waren. Die EZB wiederholte ihren Optimismus in Bezug auf die guten Wirtschaftsaussichten und rechnet mit lang anhaltenden Lohnanstiegen in den kommenden Jahren.

Diese wirtschaftliche Entwicklung veranlasste die EZB, ihre mittelfristige Inflationsprognose deutlich nach oben zu korrigieren, was eine starke Reaktion der EZB impliziert. Dadurch rechtfertigte sie einen Zinserhöhungszyklus, indem sie eine geldpolitische Normalisierung und eine erste Zinsanhebung um 25 Bp ankündigte, die auf dem EZB-Forum in Sintra, Portugal, im Juli bestätigt wurde.

Der russische Einmarsch in der Ukraine war ein Schock für die Bevölkerung der Eurozone, da der Krieg an ihrer Peripherie stattfindet. Der Euro-Markt befürchtet eine Konjunkturabschwächung aufgrund der Inflationsrate. Sie belastet den Konsum und wird zusätzlich durch die Sanktionen gegen Russland verstärkt. Ein solches Stagnationsszenario ist für den Markt für Euro-Unternehmensanleihen aufgrund des Rezessionsrisikos und der Abhängigkeit von der russischen Wirtschaft und den Exporten nachteilig. Die europäische Wirtschaft ist wesentlich mehr gefährdet als die US-amerikanische, insbesondere wenn es zu Störungen bei der Erdgasversorgung kommt. Daher schnitten Unternehmensanleihen aufgrund der starken Wiedereröffnung des Primärmarktes schlechter ab. Trotz des sprunghaften Anstiegs der Spreads kam es zu keine Liquidationsgeschäften, auch nicht bei Hochzinsanleihen: Der iTraxx Crossover Credit Index stieg deutlich um 338 Bp auf einen Spread von 580 Bp. Die Märkte in der Peripherie entwickelten sich ebenfalls unterdurchschnittlich, allerdings in geringerem Maße, wenn man bedenkt, dass sich ihre Kreditqualität dank der Unterstützung durch die vom Wiederaufbaufonds der EU („Next Generation Fund“) ausgeschütteten „Zuschüsse“ grundsätzlich verbessert hat.

Nach einer kräftigen und raschen Markterholung im Juli kehrte der scharfe Bärenmarkt im Gefolge schleppender Wirtschaftsdaten in der zweiten Jahreshälfte 2022 zurück. Die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen stieg erneut deutlich von 1,33 % auf 2,56 %, ihr höchster Stand seit 2011. Es folgten eine neue hohe Inflationsrate von 10,7 % im Oktober in der Eurozone und die aggressive EZB-Politik, die im Juli begann und eine deutliche Leitzinsanpassung von 2,5 % zur Bekämpfung des Inflationsdrucks mit sich brachte. Den größten Renditesprung ergab sich bei den kurzfristigen Laufzeiten, wie der Anstieg der Rendite des 2-jährigen Schatz-Satzes um 2,12 % in der zweiten Hälfte des Jahres 2022 zeigt. Ein Ausverkauf von Anleihen führte zu einer erneuten Underperformance des Marktes für Unternehmensanleihen, und der iTraxx Crossover Protection Spread stieg im dritten Quartal um 90 Bp.

Diese pessimistischen Aussichten wurden durch das Forum in Jackson Hole verstärkt, auf dem die Zentralbanker den Märkten eine knappe und unmissverständliche Botschaft übermittelten: Sie beabsichtigen, ihre Politik in den restriktiven Bereich zu bringen und dort so lange zu belassen, bis die Inflation nachhaltig gesunken ist. Besonders beunruhigt war die EZB über den anhaltenden Anstieg der Energiepreise nach der Entscheidung Russlands, die Gaslieferungen aus der Nord-Stream-1-Pipeline einzustellen. Ab dem Sommer reagierte Deutschland mit einer Beschleunigung seiner Gasspeicherung, wodurch die Gasvorräte schneller als erwartet wieder aufgefüllt werden konnten und was in der Folge zu einer Normalisierung der Energiepreise führte. Darüber hinaus einigte sich die EU auf Obergrenzen für die Strom- und Gaspreise, während die Regierungen beschlossen, Energiepläne wie den deutschen Fonds in Höhe von 200 Mrd. EUR umzusetzen. So erholte sich der Markt für Unternehmensanleihen im letzten Quartal des Jahres deutlich, und der iTraxx Crossover Spread fiel von seinem Höchststand im September von 670 Bp auf 474 Bp gegen Ende Dezember.

Die Staatsanleihen der Peripherieländer folgten dem Kreditmarkt im Tandem, entwickelten sich aber aufgrund der Neuwahlen in Italien im September weniger gut. Das Ergebnis der Wahl war eine Mitte-Rechts-Koalition, was auf ein höheres öffentliches Defizit deuten könnte.

Im ersten Quartal des Berichtszeitraums haben wir die Duration des Portfolios mit Kern- und Semi-Kernländern um zwei Jahre erhöht. In Anbetracht des neuen Kontextes steigender Renditen und im Vorfeld des starken Primärmarktes im ersten Quartal 2022 haben wir unser nicht zum Kerngeschäft gehörendes Engagement reduziert, indem wir eine Long-Position in Italien beibehalten haben. In der Folge stabilisierten wir die Duration bei 2,5 Jahren. Aufgrund von Inflations Sorgen bevorzugten wir Abflachungsstrategien und waren am kurzen Ende der Kurve nur wenig engagiert. In Nicht-Kernländern hielten wir uns ebenfalls zurück und bevorzugten eine Long-Position in Kroatien, da Kroatien voraussichtlich am 1. Januar 2023 das 20. Mitglied der Eurozone sein wird.

## Euro Bond Absolute Return – Bericht des Investment-Managers (Fortsetzung)

Zu Beginn des dritten Quartals des Berichtszeitraums hielten wir das Durationsengagement hoch, um von der starken Erholung der Anleihenmärkte zu profitieren. Ende Juli nahmen wir dann unsere Gewinne vollständig mit. Im August beschlossen wir, unsere Positionierung in der Renditekurve mit 10-jährigen Swaps und Verkäufen am langen Ende der Kurve zu ändern. Im September bevorzugten wir außerdem Strategien zur Verengung der Swap-Spreads und Proxy-Swaps. Im Oktober erhöhten wir das Durationsengagement, als die Rendite auf die 10-jährige Bundesanleihe auf über 2,25 % anstieg. Wir nahmen Swaps auf und gaben Staatsanleihen ab, da wir davon ausgingen, dass sich die Swap-Spreads mit den Rückzahlungen der längerfristigen Refinanzierungsgeschäfte (Targeted Longer-Term Refinancing Operations, „TLTRO“) normalisieren würden. In den osteuropäischen Ländern waren wir auf dem Primärmarkt aktiv. Aufgrund der starken Erholung italienischer Schuldtitel nahmen wir die Gewinne bei den BTPs, behielten aber ein Engagement in BTP Italia Linkers, die an die inländische Inflation gebunden sind. Ende des Jahres verringerten wir das Durationsengagement des Portfolios, da die Rendite auf 10-jährige Bundesanleihen unter 1,90 % fiel und damit weit unter dem von der EZB für Gewinnmitnahmen anvisierten Mindestsatz von 2,5 % lag. Unsere Sicht der Lage wurde durch die aggressive Rhetorik der EZB-Sitzung Mitte Dezember bestätigt.

Im ersten Quartal des Berichtszeitraums haben wir unser Engagement bei Unternehmensanleihen taktisch teilweise mit einer iTraxx-Crossover-Absicherung für nominal bis zu 8 % abgesichert. Wir hatten bei BBB-Emittenten und Hochzinsanleihen Long-Positionen von im Durchschnitt 15 %. Da die europäische Wirtschaft aufgrund des Risikos einer Unterbrechung der Erdgaslieferungen durch die russische Invasion in der Ukraine stärker gefährdet ist als die US-amerikanische, schichteten wir von Euro-Emittenten in US-Emittenten für in Euro emittierte Wertpapiere um. Im dritten Quartal blieben wir bei unseren Leerverkäufen von iTraxx Crossover Protection für nominal 5 %, da wir eine Erholung des Kreditmarktes von seinem niedrigen Spread-Niveau erwarteten. Im August erhöhten wir unser Engagement in hybriden Unternehmensanleihen von 6 % auf 10 % des Portfolios. Die europäische Wirtschaft ist in einem erheblichen Maße von den Sanktionen gegen Russland und den damit verbundenen Spannungen betroffen, was uns veranlasste, unser Engagement im Industriesektor zugunsten des Finanzsektors zu reduzieren.

Angesichts der steigenden Energiepreise im ersten Quartal haben wir unser Engagement in auf Euro lautenden inflationsindexierten Papieren („Euro-Linker“) und Inflation-Swaps am kurzen Ende erhöht. Wir erhöhten zudem unser Engagement in 2-jährigen US-TIPS, verkauften die Position jedoch im Februar, da wir davon ausgingen, dass die Fed zu einer geldpolitischen Straffung bereit war. Im April reduzierten wir unser Breakeven-Engagement. Wir haben mehrere Strategien umgesetzt: Inflations-Swaps, Abflachung der Breakeven-Kurve sowie Long-2y2y-Positionen und Long-5y5y-Positionen. Wir beteiligten uns am Primärmarkt an der ersten grünen französischen Linker-Anleihe und verkauften einen großen Teil unseres Engagements bei BTP Italia vor der Ausgabe der neuen 8-jährigen Anleihe.

Während des Sommers stiegen die Erdgaspreise auf 350 EUR/MWh, da Deutschland und andere europäische Länder ihre Gasspeicherkapazitäten rasch aufzufüllen begannen. Wir haben unser Linker-Engagement bei 4-jährigen Laufzeiten erhöht, um von der Verlängerung der Indexduration zum Monatsende und von der angebotsarmen Periode im Sommer zu profitieren. Im September reduzierten wir unsere Beteiligungen an Linkern und schlossen einige Strategien in Inflation-Swaps mit Gewinn (5y5y).

Im vierten Quartal setzten wir mehrere Strategien über Inflation-Swaps um: Long 5y5y EUR vs. 5y5y USD und reine Long 3y EZ CPI. Außerhalb der Eurozone bauten wir eine Position in 10-jährigen britischen Breakeven-Anleihen auf. Sie waren attraktiv bewertet, und wir verkauften sie wieder nach einer Breakeven-Ausweitung um 50 Bp. Im November erhöhten wir unser Linker-Engagement im Laufe des Monats durch den Kauf neuer BTP Italia (6-jährige Laufzeit), deren Breakeven nicht mit dem starken Anstieg der italienischen Nominalsätze Schritt halten konnte. Mitte Dezember sahen wir dann den Zeitpunkt gekommen, unser Linker-Engagement zu reduzieren und nur einige kurzfristige BTP Italia für einen positiven Carry im Januar zu behalten.

Wir glauben, dass die Anleger ihren Schwerpunkt in den kommenden Monaten des Jahres 2023 auf das Tauziehen zwischen Lohnsteigerungen und wirtschaftlicher Rezession legen könnten. Letztere könnte infolge des anhaltenden Pessimismus bei Verbrauchern und Unternehmen geschehen: Das Risiko einer Ära mit niedrigem Wachstum in der Eurozone hat sich vor dem Hintergrund der immer noch hohen Energiepreise, der Ausweitung der Credit-Spreads, des Renditeanstiegs und der Unterbrechung der Lieferketten erhöht. Tatsächlich, so haben wir das Gefühl, wird die EZB wiederholt ihren Leitzins erhöhen, um den Rückgang der Kerninflation in der Eurozone zu unterstützen. Da wir davon ausgehen, dass die Euro-Inflation ihren Höhepunkt erreicht hat, glauben wir, dass sich die Euro-Zinssätze und Credit-Spreads im Anschluss an den starken Primärmarkt zu Beginn des Jahres stabilisieren könnten. Die Anleihezinsen und -Spreads sind im Vergleich zum potenziellen langfristigen Wachstum attraktiv und berücksichtigen bereits einen starken Anstieg der EZB-Leitzinsen.



## Euro Opportunistic Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I -15,59 %. Der Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (Total Return, abgesichert, EUR) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -17,17 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen.

In der ersten Hälfte des Berichtszeitraums kam es im Zuge steigender Inflationsraten zu einem starken Rückgang am Euro-Anleihenmarkt. Die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen stieg deutlich von -0,18 % auf 1,33 %, ihren höchsten Stand seit 2014. Dies markiert den Datenpunkt des schnellsten Preisanstiegs seit den 1970er Jahren, hauptsächlich bedingt durch höhere Rohstoffpreise infolge Russlands Einmarsch in die Ukraine sowie durch Lebensmittelpreise als zweite Runde der Folgen höherer Energiepreise und des Rückgangs der Exporte osteuropäischer Länder, da sowohl Russland als auch die Ukraine wichtige Exporteure von Agrarprodukten und Düngemitteln sind. Darüber hinaus gab es infolge chinesischer Lockdown-Beschränkungen weiterhin Lieferkettenstörungen. Folglich erreichte der langfristige Inflationsausblick des Markts 2,5 % und veranlasste die Europäische Zentralbank („EZB“) zur Frage, ob die Inflation langfristig noch verankert ist. Tatsächlich sind die Inflationsdaten für den Euro das ganze Jahr über gestiegen: Die VPI-Inflation in Deutschland verzeichnete im März einen starken monatlichen Anstieg von 2,5 %, den höchsten seit der Wiedervereinigung im Jahr 1992. Dadurch lag der Anstieg im Jahresvergleich über 7 %, was vor allem auf die höheren Energiepreise zurückzuführen ist.

Als die EZB den Lohnanstieg in der Eurozone im ersten Quartal 2022 veröffentlichte, stieg dieser Indikator für die ausgehandelten Löhne von 1,8 % im vierten Quartal 2021 auf 2,8 % im ersten Quartal 2022. Dies war allerdings teilweise auf tarifliche Einmalzahlungen wie in der Chemiebranche in Deutschland zurückzuführen, die zum Teil das Ergebnis verzögerter Lohnverhandlungsrunden aufgrund des Krieges in der Ukraine waren. Die EZB wiederholte ihren Optimismus in Bezug auf die guten Wirtschaftsaussichten und rechnet mit lang anhaltenden Lohnanstiegen in den kommenden Jahren.

Diese wirtschaftliche Entwicklung veranlasste die EZB, ihre mittelfristige Inflationsprognose deutlich nach oben zu korrigieren, was eine starke Reaktion der EZB impliziert. Dadurch rechtfertigte sie einen Zinserhöhungszyklus, indem sie eine geldpolitische Normalisierung und eine erste Zinsanhebung um 25 Basispunkte („Bp“) ankündigte, die auf dem EZB-Forum in Sintra, Portugal, im Juli bestätigt wurde.

Der russische Einmarsch in der Ukraine war ein Schock für die Bevölkerung der Eurozone, da der Krieg an ihrer Peripherie stattfindet. Der Euro-Markt befürchtet eine Konjunkturabschwächung aufgrund der Inflationsrate. Sie belastet den Konsum und wird zusätzlich durch die Sanktionen gegen Russland verstärkt. Ein solches Stagnationsszenario ist für den Markt für Euro-Unternehmensanleihen aufgrund des Rezessionsrisikos und der Abhängigkeit von der russischen Wirtschaft und den Exporten nachteilig. Die europäische Wirtschaft ist wesentlich mehr gefährdet als die US-amerikanische, insbesondere wenn es zu Störungen bei der Erdgasversorgung kommt. Daher schnitten Unternehmensanleihen aufgrund der starken Wiedereröffnung des Primärmarktes schlechter ab. Trotz des sprunghaften Anstiegs der Spreads kam es zu keine Liquidationsgeschäften, auch nicht bei Hochzinsanleihen: Der iTraxx Crossover Credit Index stieg deutlich um 338 Bp auf einen Spread von 580 Bp. Die Märkte in der Peripherie entwickelten sich ebenfalls unterdurchschnittlich, allerdings in geringerem Maße, wenn man bedenkt, dass sich ihre Kreditqualität dank der Unterstützung durch die vom Wiederaufbaufonds der EU („Next Generation Fund“) ausgeschütteten „Zuschüsse“ grundsätzlich verbessert hat.

Nach einer kräftigen und raschen Markterholung im Juli kehrte der scharfe Bärenmarkt im Gefolge schleppender Wirtschaftsdaten in der zweiten Jahreshälfte 2022 zurück. Die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen stieg erneut deutlich von 1,33 % auf 2,56 %, ihr höchster Stand seit 2011. Es folgten eine neue hohe Inflationsrate von 10,7 % im Oktober in der Eurozone und die aggressive EZB-Politik, die im Juli begann und eine deutliche Leitzinsanpassung von 2,5 % zur Bekämpfung des Inflationsdrucks mit sich brachte. Der größte Renditesprung ergab sich bei den kurzfristigen Laufzeiten, wie der Anstieg der Rendite des deutschen 2-jährigen Schatz-Satzes um 2,12 % in der zweiten Hälfte des Jahres 2022 zeigt. Ein Ausverkauf von Anleihen führte zu einer erneuten Underperformance des Kreditmarktes, und der iTraxx Crossover Protection Spread stieg im dritten Quartal um 90 Bp.

Diese pessimistischen Aussichten wurden durch das Forum in Jackson Hole verstärkt, auf dem die Zentralbanker den Märkten eine knappe und unmissverständliche Botschaft übermittelten: Sie beabsichtigen, ihre Politik in den restriktiven Bereich zu bringen und dort so lange zu belassen, bis die Inflation nachhaltig gesunken ist. Besonders beunruhigt war die EZB über den anhaltenden Anstieg der Energiepreise nach der Entscheidung Russlands, die Gaslieferungen aus der Nord-Stream-1-Pipeline einzustellen. Ab dem Sommer reagierte Deutschland mit einer Beschleunigung seiner Gasspeicherung, weshalb das Land unerwartet schnell die Gasvorräte aufgefüllt hatte, was in der Folge zu einer Normalisierung der Energiepreise führte. Darüber hinaus einigte sich die EU auf Obergrenzen für die Strom- und Gaspreise, während die Regierungen beschlossen, Energiepläne wie den deutschen Fonds in Höhe von 200 Mrd. EUR umzusetzen. So erholte sich der Markt für Unternehmensanleihen im letzten Quartal des Jahres deutlich, und der iTraxx Crossover Spread fiel von seinem Höchststand im September von 670 Bp auf 474 Bp gegen Ende Dezember.

Die Staatsanleihen der Peripherieländer folgten dem Kreditmarkt im Tandem, entwickelten sich aber aufgrund der Neuwahlen in Italien im September weniger gut. Das Ergebnis der Wahl war eine Mitte-Rechts-Koalition, was auf ein höheres öffentliches Defizit deuten könnte.

Seit dem Beginn des einjährigen Ausverkaufs an den Anleihenmärkten hat das Portfolio aktiv eine untergewichtete Duration gemanagt. Dies wurde hauptsächlich über eine Untergewichtung von Anleihen aus Deutschland und Frankreich implementiert. Darüber hinaus nutzten wir die Marktvolatilität, indem wir Long-Put- und Call-Optionspositionen aktiv verwalteten. Wir haben bei fast dem gesamten übergewichteten Inflationsengagement, das in der zweiten Jahreshälfte etwa 10 % des Nettovermögens des Fonds ausmachte, die Gewinne mitgenommen.

## Euro Opportunistic Bond – Bericht des Investment-Managers (Fortsetzung)

Parallel dazu haben wir schrittweise Gewinne aus unserem übergewichteten Engagement in den Peripherieländern mitgenommen, um in supranationale Titel und Euro-Agenturen wie die „Europäische Union“ mit langen Laufzeiten zu investieren. Die aggressive Politik der EZB verstärkt das Risiko durch die italienische Schuldenlast, insbesondere nach den Präsidentschaftswahlen in Italien

Wir haben Unternehmensanleihen das ganze Jahr über mit einer Duration von etwa 0,75 bis 1 Jahr gegenüber dem Index übergewichtet. Wir waren „Long“ bei mit BBB gerateten Anleihen und untergewichtet in mit AA & A gerateten Anleihen. Wir haben vor allem den Bankensektor übergewichtet, der unserer Meinung nach von den höheren Zinsen profitieren sollte. Was die Frage nach höheren Renditen angeht, so haben wir unsere Anlagen gestreut, so dass als Hochzinsanleihen eingestufte Anleihen durchschnittlich 15 % des Fondsvermögens ausmachen. Unser Anlagefokus bestand erneut darin, aktiv zu sein, um von auf dem Primärmarkt gebotenen Chancen zu profitieren, da viele Auktionen von Unternehmensanleihen einen zusätzlichen Spreadaufschlag boten.

Im Dezember haben wir unser Engagement in Unternehmensanleihen aufgrund des zunehmenden Rezessionsrisikos infolge der restriktiven EZB-Politik und im Vorfeld des starken Primärmarkts im ersten Quartal 2023 vorsichtig reduziert. Außerdem kauften wir ITraxx Crossover Protection für eine Nominalverzinsung von 4 %.

Wir glauben, dass die Anleger ihren Schwerpunkt in den kommenden Monaten des Jahres 2023 auf das Tauziehen zwischen Lohnsteigerungen und wirtschaftlicher Rezession legen werden. Letztere könnte infolge des anhaltenden Pessimismus bei Verbrauchern und Unternehmen geschehen: Das Risiko einer Ära mit niedrigem Wachstum in der Eurozone hat sich vor dem Hintergrund der immer noch hohen Energiepreise, der Ausweitung der Credit-Spreads, des Renditeanstiegs und der Unterbrechung der Lieferketten erhöht.

Tatsächlich hat die EZB wiederholt ihren Leitzins erhöht, um den Rückgang der Kerninflation in der Eurozone zu unterstützen. Eine derart aggressive Politik erhöht das Rezessionsrisiko, das in den kommenden Monaten sowohl die Peripherie als auch den Markt für Unternehmensanleihen belasten dürfte.

Da wir davon ausgehen, dass die Euro-Inflation ihren Höhepunkt erreicht hat, erwarten wir, dass sich die Euro-Zinssätze und Credit-Spreads im Anschluss an den starken Primärmarkt zu Beginn des Jahres stabilisieren sollten. Die Anleihezinsen und -Spreads sind im Vergleich zum potenziellen langfristigen Wachstum attraktiv und berücksichtigen bereits einen starken Anstieg der EZB-Leitzinsen.

## European High Yield Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I -9,53 %. Im selben Zeitraum lag die Rendite des ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR) (der „Index“), bei -11,70 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

In einem für die meisten festverzinslichen und aktienbasierten Anlageklassen turbulenten Jahr 2022 beendete der Markt für europäische Hochzinsanleihen den Berichtszeitraum mit negativen Renditen. Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine, die hohen Inflations- und Energiepreise, die Verschärfung der finanziellen Bedingungen und die Verlangsamung der Wirtschaftstätigkeit trugen zu der allgemein risikoscheuen Stimmung bei. Die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine und andere Faktoren trieben die Inflation in Europa auf den seit mehreren Jahrzehnten höchsten Stand. Vor diesem Hintergrund begannen die EZB und die Bank of England Anfang 2022 mit aggressiven Zinserhöhungen. Sie werden sich voraussichtlich fortsetzen, bis die Inflation unter Kontrolle ist. Richtungsweisende europäische Staatsanleihen mit längeren Laufzeiten stiegen 2022 an, da das nominale BIP-Wachstum robust blieb und sich die Inflation hielt. Die große Sorge, dass in Europa aufgrund von Energieengpässen in diesem Winter „die Lichter ausgehen“ könnten, hat sich nicht bestätigt, und das wärmere Wetter sowie die unerwartet hohen Gasreserven haben zu einer Abkühlung der Energiepreise beigetragen, was sich wiederum positiv auf die Inflation und die Fähigkeit der Unternehmen auswirkt, ihre Margen zu sichern. Darüber hinaus haben sich die politischen Turbulenzen im Vereinigten Königreich und anderswo beruhigt, und wir antizipieren, dass die derzeitige Pattsituation in der Ukraine das „am wenigsten schlimme“ Ergebnis für die Märkte sein wird. Nachdem die Stimmung im weiteren Verlauf des Jahres „weniger schlecht“ wurde, kam es im vierten Quartal zu einer soliden Erholung am europäischen Hochzinsmarkt. Trotz der Volatilität im Laufe des Jahres wurde die Verbesserung oder Stabilität der Fundamentaldaten von Unternehmensanleihen für die meisten Emittenten nicht beeinträchtigt, da viele in einer Position waren, Preiserhöhungen weiterzugeben und sich an das neue Geschäftsumfeld anzupassen. Die Differenzierung im Kreditbereich war auch im Jahr 2022 ein vorherrschender Faktor. Darüber hinaus sanken die Ausfallquoten in der ersten Hälfte des Jahres 2022 auf ein Allzeittief und stiegen dann in der zweiten Jahreshälfte nur geringfügig an.

Aus sektoraler Sicht wirkte sich die Wertpapierauswahl im Laufe des Jahres innerhalb des Sektors Immobilien & Bauunternehmen (sowie dessen Untergewichtung gegenüber dem Index) ebenso deutlich positiv auf die Performance aus wie die Einzeltitelauswahl innerhalb des Sektors Support-Dienstleistungen (und dessen Übergewichtung) sowie eine Übergewichtung des Sektors Großmärkte am positivsten auf die Performance aus. Im Gegensatz dazu waren die Wertpapierauswahl innerhalb und die Untergewichtung des Sektors Automobile & Autoteile und Fluggesellschaften sowie die Untergewichtung von Baustoffen für die größten Abzüge von der Performance verantwortlich. Innerhalb der Kreditrating-Positionierung des Portfolios trugen die Wertpapierauswahl und eine Übergewichtung von Papieren mit B-Rating sowie die Titelauswahl unter mit CCC und darunter sowie in mit BB gerateten Papieren am meisten zur Performance bei, während eine Untergewichtung in mit BB gerateten Wertpapieren und eine Übergewichtung von Emittenten mit CCC-Rating oder niedriger die Performance am stärksten minderten. Im Jahresdurchschnitt war das Portfolio bei Wertpapieren mit einem Rating von B und CCC und darunter Übergewichtet, bei Wertpapieren mit einem Rating von BBB und darüber leicht Übergewichtet und bei Emittenten mit einem Rating von BB untergewichtet.

Die Spreads für europäische Hochzinsanleihen weiteten sich 2022, doch wir denken, dass die Bewertungen die Anleger für die unterdurchschnittlichen Ausfallaussichten mehr als entschädigen. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hat zu einer Verlangsamung des realen BIP-Wachstums geführt, während die nachlassende Nachfrage dazu beigetragen hat, dass die Inflation etwas abkühlt. Sie liegt allerdings immer noch über den Zielvorgaben der Zentralbank. Die Normalisierung der Lieferketten und Veränderungen im Verbraucherverhalten dürften neben anderen Faktoren den Aufwärtsdruck auf die Inflation weiter mildern, was letztendlich zu einem weniger aggressiven Kurs der Zentralbankpolitik führen könnte. Unsere Analysten konzentrieren sich jedoch weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer Rezession. Während sich das reale Wirtschaftswachstum verlangsamt hat, sollten das solide nominale BIP-Wachstum und die sinkenden Energiepreise die Fundamentaldaten der Emittenten weiterhin stützen. Während sich die Lagerbestände infolge der nachlassenden Nachfrage wieder füllen, konzentrieren wir uns weiterhin auf sektorspezifische Dynamiken und idiosynkratische Risiken für einzelne Emittenten. Trotz der kurzfristigen Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum und die gestraffte Geldpolitik der Zentralbanken ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Kreditverschlechterungen und die Aufnahme in das Portfolio der ausnahmslos „besten Ideen“ – gut aufgestellt sind, um von der erhöhten Volatilität zu profitieren.

## European Sustainable Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I -24,96 %. Der MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -9,49 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.

2022 war ein turbulentes Jahr für die Märkte, das von einer steigenden Inflation, einem aggressiven Zentralbankkurs und geopolitischen Schocks geprägt war. Der Großteil der Wertentwicklung von Vermögenswerten war in diesem Jahr äußerst negativ, da sowohl globale Aktienwerte als auch Anleihen weltweit abgestoßen wurden. Zu Beginn des Jahres war die Inflation bereits aufgrund von angebotsseitigen Problemen auf dem Weg nach oben. Sie hatten sich aus dem wirtschaftlichen Neustart nach der COVID-19-Pandemie ergeben. Der verheerende Einmarsch der russischen Streitkräfte in der Ukraine im Februar hat die Märkte erschüttert, und als die Länder sich eilig daran machten, Sanktionen zu verhängen, stiegen die Lebensmittel- und Energiepreise weiter an. Im Jahr 2022 erreichte die Gesamtinflation einen historischen Höchststand: Der US-Verbraucherpreisindex stieg im Juni um 9,1 % gegenüber dem Vorjahr, und die Zentralbanken begannen mit einer Reihe von Zinserhöhungen, die sowohl im Tempo als auch ihrem Ausmaß unerwartet waren. Insgesamt haben die Zentralbanken der G10-Staaten im Jahr 2022 über 2700 Basispunkte an Zinserhöhungen vorgenommen.

Die Rezessionsrisiken in Europa und im Vereinigten Königreich nahmen weiter zu, da sich die Energiekrise verschärfte und der Dollar gegenüber den wichtigsten Weltwährungen im Jahr 2022 extrem stark war. Im letzten Quartal kam es dann allerdings zu einer deutlichen Trendwende. Die Wirtschaftsaktivitäten Chinas waren aufgrund der Schwäche des Immobilienmarktes und der Beibehaltung der Null-COVID-Politik während des größten Teils des Jahres gedämpft, wobei in vielen Großstädten strenge und dauerhafte Lockdowns in Kraft waren. Im Dezember lockerte Peking jedoch die Kontrollen und signalisierte damit den Beginn der mit Spannung erwarteten Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft. Schließlich überraschte die Bank of Japan gegen Jahresende die Märkte, als sie ihre seit langem verfolgte Kontrolle der Renditekurve änderte, was die weltweiten Anleihenrenditen unter Aufwärtsdruck setzte.

Im Berichtszeitraum schnitt das Portfolio mit einer Rendite von -24,96 % schlechter ab als der Index, der auf -9,49 % kam. Trotz einer starken Performance im vierten Quartal 2022 beendete das Portfolio das Jahr im negativen Bereich, wobei die Einzeltitelauswahl und die Asset-Allokation die Performance drückten. Die Titelauswahl in den Sektoren Finanzwerte und Nicht-Basiskonsumgüter beeinträchtigte die Performance am stärksten, während die Titelauswahl in den Sektoren Industrierwerte und Informationstechnologie dabei half, die Underperformance abzumildern. Auf Sektorebene wirkte sich die Nullgewichtung des Energiesektors negativ auf die Wertentwicklung aus, da dieser Sektor im Jahr 2022 mit einem Anstieg von 28 % die beste Performance erzielte. Eine gegenüber dem Index übergewichtete Position in Informationstechnologie beeinträchtigte die Performance ebenfalls, da der Sektor im Laufe des Jahres insgesamt um 33 % nachgab. Eine Nullgewichtung von Immobilien, dem Sektor mit der schlechtesten Performance, trug jedoch dazu bei, die Underperformance des Portfolios abzuschwächen. Auf der Ebene der Einzeltitel waren unsere Beteiligungen an S4 Capital, HelloFresh und Dechra Pharma im Jahr 2022 die schwächsten Performer, während Novo Nordisk und HomeServe einen positiven Effekt auf die Performance hatten.

Im Laufe des Jahres führte das Team mehrere Gespräche mit den Unternehmen im Portfolio zu einem breiten Spektrum an nachhaltigen Themen. In unserem Gespräch mit dem privaten Vermögensverwalter Partners Group Holding diskutierten wir die nach wie vor starke wirtschaftliche Dynamik. Partners Group präsentierte uns in diesem Zusammenhang sein klares Ziel, im Bereich Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“), die Kohlenstoffemissionen bis 2050 auf Null zu reduzieren. Die Datenerfassung ist jedoch problematisch, da das Unternehmen direkt in 1.000 und indirekt in 14.000 Unternehmen investiert, und die Anwendung allzu strenger Verpflichtungen könnte auch die Anlagegelegenheiten einschränken. Die Aufsicht über die praktische Umsetzung von ESG-bezogenen Plänen bei Partners Group wird an die Verwaltungsräte der kontrollierten Unternehmen delegiert und erfolgt entlang einer von Partners Group erstellten Wesentlichkeitsmatrix. In der Regel helfen externe Berater bei der Umsetzung, da es kleinen Unternehmen oft an internen Kompetenzen fehlt. Partners Group setzt drei ESG-Ziele pro kontrollierter Beteiligung, die wesentlich und messbar sind. Partners Group verfügt über eine ESG-Integration für alle seine Investitionen, die gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft sind.

Trotz Schwankungen auf dem breiteren Markt, makroökonomischen Entwicklungen oder Schocks wie die COVID-19-Pandemie sind wir davon überzeugt, dass unser Portfolio dank qualitativ hochwertiger Unternehmen, bei denen Nachhaltigkeit ihren Wettbewerbsvorteil stärkt, widerstandsfähig und attraktiv bleibt. Wir konzentrieren uns auf Unternehmen, die (1) eine dauerhafte Wettbewerbsposition haben, die also unserer Meinung nach schwer zu reproduzierende Wettbewerbsvorteile besitzen; (2) Beeinträchtigungen vermeiden, d. h. wir glauben, dass sie ESG-Praktiken sorgfältig handhaben; und (3) sich an Veränderungen anpassen, d. h. sie konzentrieren sich unserer Meinung nach auf Innovation und kontinuierliche Verbesserung.

Wir gehen davon aus, dass die Regulierungsbehörden weiterhin auf eine nachhaltigere Entwicklung der Weltwirtschaft drängen werden. Angesichts des schwierigen Markthintergrunds hängt der Erfolg der meisten Qualitätsunternehmen in unseren Augen mehr und mehr von der Entwicklung immateriellen Kapitals ab – innovative Technologie, Forschung & Entwicklung, Humankapital und Marken- oder Plattformreputation –, um eine dauerhafte Wettbewerbsposition zu schaffen. **Diese dauerhafte Wettbewerbsposition kann durch eine gute Corporate Citizenship gestärkt werden, indem ESG-Praktiken sorgfältig gemanagt werden.** Wir denken, dass eine vorausschauende Analyse dieser Kombination aus Qualitätsmerkmalen, ESG-Faktoren und idiosynkratischen Merkmalen für die Identifizierung der „Transition Winners“ der neuen Wirtschaft von kritischer Bedeutung ist. Wir denken, dass die Märkte an einem Wendepunkt angekommen zu sein scheinen und das Gleichgewicht zwischen Wachstum und Inflation neu bewerten, da Daten allmählich Anzeichen dafür zeigen, dass die Zentralbankstraffung sich in die Konjunktur einschleicht und das Rezessionsrisiko steigt. Unserer Meinung nach wird der künftige Pfad höchst abhängig von der Zentralbankpolitik und dem nachlassenden Inflationsdruck in Richtung des Inflationsziels der Fed abhängen.

## Event Driven – Bericht des Investment-Managers

Seit der Auflegung am 26. Oktober 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf 1,20 %. Der als Benchmark dienende S&P 500 (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 0,49 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Das Portfolio wurde am 26. Oktober mit einem Volumen von 38,1 Mio. USD aufgelegt. In der kurzen Zeit, in der das Portfolio gehandelt hatte, erzielte es eine Gesamrendite von 1,2 %. Zwei seiner Teilstrategien, Risk-Arbitrage und Market Neutral Catalyst, trugen positiv zur Rendite bei.

Das einzige nennenswerte Ereignis in diesem kurzen Zeitraum war die Beendigung der Übernahme der Rogers Corporation durch DuPont am 1. November 2022. Das Portfolio war bei diesem Geschäft nicht involviert und konnte so Verluste vermeiden, die viele Marktteilnehmer in der Risiko-Arbitrage-Investmentgemeinde trafen.

Mit Blick auf das Jahr 2023 freuen wir uns auf die vor uns liegenden Chancen. In volatilen und sogar in bandbreitengebundenen Märkten versuchen die Managementteams, den Wert ihrer Portfoliounternehmen zu steigern, indem sie verschiedene, ihnen zur Verfügung stehende Hebel ansetzten. Sie können sich nicht darauf verlassen, dass die Erwartungen der Anteilhaber durch wiederholte Expansion eines Bullenmarktes erfüllt werden. Angesichts des aktuellen Umfelds gehen wir davon aus, dass ein hohes Maß an Unternehmensaktivitäten die Chancen für Event-Driven-Strategien erhöhen wird – ein idealer Hintergrund für unseren Anlageansatz. Darüber hinaus sind die Ergebnisse von Unternehmensereignissen oft weniger marktabhängig. Sie weisen zudem eine geringe Korrelation zum Beta des breiteren Marktes auf, was Möglichkeiten zur Diversifizierung von Anlageportfolios und zur Nutzung einer differenzierten Alpha-Quelle bietet. Was die Fusionsaktivitäten betrifft, so bleiben die Verwaltungsräte vorerst zurückhaltend. Wir denken allerdings, dass der externe Druck zu Konsolidierungen, die Erzielung von Größenvorteilen und Kostensenkungen bestehen bleibt und zu einer bedeutenden Transaktionstätigkeit führen wird, sobald die Marktvolatilität nachlässt. Die Anzahl und die gesamte Marktkapitalisierung der Transaktionen sind in letzter Zeit zurückgegangen, aber wir glauben, dass der risikobereinigte Gewinn-Pool nach wie vor recht robust ist. Diese Gelegenheiten erfordern ein sorgfältiges Management des Risikokapitals bei einzelnen Geschäften und korrelierten Transaktionen, während wir darauf warten, dass sich ein größeres Universum mit Fehlbewertungen herauskristallisiert.

## Global Bond – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -15,67 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, nicht abgesichert, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Minus von 16,25 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Der Berichtszeitraum war schwierig für die festverzinslichen Märkte, da eine hartnäckig hohe Inflation, eine aggressive Zentralbankstraffung und die zunehmende Wahrscheinlichkeit einer erheblichen Wachstumsverlangsamung für einen Anstieg bei Zinsen und für eine Ausweitung von Credit-Spreads sorgten. Die Credit-Spreads ließen im vierten Quartal des Berichtszeitraums teilweise wieder nach, da die Nachfrage seitens der Anleger aufgrund attraktiverer Gesamtrenditen anstieg. Insgesamt stieg die Rendite auf 10-jährige US-Staatsanleihen im Berichtszeitraum um +236 Bp. Die Renditen 2-jähriger Staatsanleihen mit mittleren Laufzeiten in Deutschland (+275 Bp), dem Vereinigten Königreich (+270 Bp) und Japan (+35 Bp) waren ähnlich hoch. Die Credit-Spreads globaler Unternehmensanleihen mit<sup>1</sup> und ohne<sup>2</sup> Investment Grade weiteten sich im Berichtszeitraum um +50 Bp bzw. +164 Bp.

Den größten Beitrag zur relativen Outperformance leistete die im Berichtszeitraum positive Zinspositionierung des Portfolios. Das Portfolio profitierte von der Untergewichtung der Zinsen in Großbritannien, Kerneuropa, Schweden und Japan. Umgekehrt wirkte sich das übergewichtete Engagement in neuseeländischen Zinsen leicht negativ aus. Das Engagement des Portfolios in Schuldtiteln aus Schwellenländern und die Übergewichtung globaler Unternehmensanleihen mit Investment Grade beeinträchtigten die Performance am stärksten, jedoch konnte eine positive Titelauswahl unter besagten IG-Unternehmensanleihen die Auswirkungen abfedern. Die aktive Positionierung in verbrieften Sektoren, einschließlich einer Übergewichtung von Agency Mortgage-Backed Securities und Commercial Mortgage Backed Securities, sowie eine Untergewichtung von gedeckten Anleihen Bonds trugen ebenfalls zur Wertsteigerung bei.

Nach einem Jahr mit einer weltweiten erheblichen geldpolitischen Straffung gehen wir davon aus, dass sich die Inflation weiter von ihrem Höchststand entfernen wird. Allerdings denken wir, dass sie auch im kommenden Jahr und möglicherweise bis ins Jahr 2024 deutlich über dem normalen Niveau und den Zielvorgaben der Zentralbanken bleiben wird. In den Sitzungen der Zentralbanken und in den Äußerungen der Entscheidungsträger kam zum Ausdruck, dass sie zur Dämpfung des Preisdrucks eine straffe Geldpolitik beibehalten müssen. Obwohl es also noch zu einigen weiteren Zinserhöhungen kommen könnte, werden die US-Zinsen am kurzen Ende unseres Erachtens noch einige Zeit hoch bleiben. Mit anderen Worten: Wir glauben, dass die Welt der Nullzinsen, so dominierend nach der globalen Finanzkrise, wahrscheinlich vorbei ist.

Wir sind der Meinung, dass die US-Notenbank einen Großteil ihrer Schwerarbeit abgeschlossen hat und erwarten, dass die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere im Jahr 2023 ruhiger sein werden. Unserer Ansicht nach könnte dies eine große Chance bieten, höhere Renditen bei begrenztem Risiko zu erzielen. Dies umso mehr angesichts des zusätzlichen Renditepolsters, das durch die letztjährige Neubewertung geschaffen wurde. Unsere größte Begeisterung ist in diesem Zusammenhang dem Investment-Grade-Markt zugeordnet.

Vorausschauend gehen wir davon aus, dass sich die Zinssätze in einer viel engeren Spanne bewegen werden als im Jahr 2022, da die Inflation nachlässt und die Zentralbanken ihre Zinsen schrittweise anheben. Wir glauben, dass das Durationsengagement weniger riskant sein dürfte als 2022. Die grundsätzlichen Bedenken hinsichtlich Unternehmensanleihen dürften jedoch zunehmen, und zwar nicht nur aufgrund der makroökonomischen Entwicklungen, sondern auch in Abhängigkeit von der Dynamik und der Finanzlage der einzelnen Emittenten. Die Einzeltitelauswahl ist in der Folge wichtiger denn je.

Trotz des Potenzials für eine wirtschaftliche Verschlechterung in diesem Jahr ist das Ausfallszenario unserer Ansicht nach relativ günstig. Der Verschuldungsgrad der Unternehmen ist allgemein niedriger und die Liquiditätsbestände sind höher als vor der Pandemie. Die Muster bei den Neuemissionen waren weniger aggressiv, sowohl was die Verwendung der Erlöse als auch die Ratingkategorien betrifft. Darüber hinaus konnten viele Unternehmen aufgrund der extrem niedrigen Renditen der letzten Jahre ihre Laufzeiten zu niedrigen Zinssätzen verlängern, wodurch in den Jahren 2023 und 2024 nur noch relativ wenige Anleihen fällig werden. Dessen ungeachtet sind wir der Meinung, dass es in den nächsten ein bis zwei Jahren zu einem Anstieg der Ausfälle bei Hochzinsanleihen kommen kann, insbesondere wenn die Rezession unerwartet schlimm ausfällt.

Was bedeutet das für die Portfoliositionierung an den Märkten für Unternehmensanleihen? Die Differenzierung im Kreditbereich könnte zunehmen, sobald sich die Auswirkungen höherer Zinsen und einer langsameren Konjunktur in den tatsächlichen Unternehmensgewinnen und -ergebnissen niederschlagen werden. Wir gehen davon aus, dass die Märkte für Unternehmensanleihen im Jahr 2022 nicht mehr von „Makro-Ergebnissen“ geleitet, sondern sich stärker an fundamentalen Ergebnissen orientieren werden. Ein wichtiger Unsicherheitsfaktor ist die Frage, ob die gemischte wirtschaftliche Entwicklung zu mehr Inflation als erwartet führen könnte und damit zu potenziell mehr Schwierigkeiten an den Finanzmärkten. Dies ist nicht unser Basisszenario, es muss aber in Betracht gezogen werden, da wir uns immer noch auf unsicherem Terrain bewegen.

<sup>1</sup> Investment Grade: Bloomberg Global Aggregate Corporate Index

<sup>2</sup> Ohne Investment Grade: Bloomberg Global High Yield Corporate Index

## Global Diversified Income FMP – 2024 – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -3,99 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere gerieten im Berichtszeitraum unter Druck, da die hartnäckig hohe Inflation, die aggressive geldpolitische Straffung durch die Zentralbanken und die zunehmende Wahrscheinlichkeit einer deutlichen Wachstumsverlangsamung die Zinsen in die Höhe trieben und die Credit-Spreads ausweiteten. Letztere gingen im vierten Quartal teilweise zurück, da die Anlegernachfrage aufgrund attraktiverer Gesamtrenditen anzog. Insgesamt stieg die Rendite auf 2-jährige US-Staatsanleihen im Berichtszeitraum als Reaktion auf die aggressive Straffung durch die US-Notenbank um +370 Bp. Die Renditen 2-jähriger Staatsanleihen in Deutschland (+338 Bp), dem Vereinigten Königreich (+289 Bp) und Japan (+13 Bp) waren ähnlich hoch. Die Spreads von Unternehmensanleihen aus Industrieländern mit<sup>1</sup> und ohne Investment Grade<sup>2</sup> weiteten sich um +50 Bp bzw. +164 Bp, während sich die Spreads von Unternehmensanleihen aus Schwellenländern („EM“) um +53 Bp ausweiteten.

Die EM-Unternehmensanleihen und ihre globalen IG-Pendants im Portfolio waren die wesentlichen Antriebskräfte hinter der negativen Wertentwicklung im Berichtszeitraum. Die Performance der Hochzinsanleihen aus Industrieländern im Portfolio war mehr oder weniger unverändert, da die Kuponzahlungen die Kursrückgänge im Wesentlichen ausgeglichen haben.

Nach dem COVID-19-Schock im Jahr 2020 gingen Investment-Grade-Unternehmen in einen defensiven Modus über und bauten Barbestände durch die Emission von Schuldtiteln auf, senkten die Kosten, pausierten Aktienrückkäufe und stornierten Pläne für Fusionen und Übernahmen. Dies führte zu einem starken fundamentalen Kredithintergrund, einschließlich rekordmäßiger EBITDA-Margen und Cashflows, während die Verschuldung auf Niveaus von vor der Pandemie zurückging. Wir gehen zwar davon aus, dass sich die Fundamentaldaten von Unternehmensanleihen von nun an abschwächen werden, doch ist es wichtig zu bedenken, dass sie in dieses langsamere Wachstumsumfeld aus einer Position der relativen Stärke eintreten. Insgesamt sind wir überzeugt, dass größere Spreads die durch höhere Zinsen und die Wirtschaftsabkühlung gestiegenen Risiken zu kompensieren scheinen. Während das langsamere Wachstum die Ratings unter Druck setzen wird, glauben wir, dass sich das Risiko durch gefallene Engel in Grenzen halten dürfte. Wir gehen davon aus, dass die Wertpapierauswahl zunehmend wichtiger wird, da die Fehlerrate bei Unternehmen in den kommenden Quartalen reduziert wird.

Wir sind überzeugt, dass die aktuelle Bewertungen im Hochzinssegment Anlegern eine attraktive Gelegenheit bieten, insbesondere angesichts unserer unterdurchschnittlichen Ausfallaussichten. Unsere Analysten konzentrieren sich jedoch weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Während sich die Lagerbestände infolge der nachlassenden Nachfrage wieder füllen, konzentrieren wir uns weiterhin auf sektorspezifische Dynamiken und idiosynkratische Risiken für einzelne Emittenten. Trotz der kurzfristigen Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum und die gestraffte Geldpolitik der Zentralbanken ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren und die Vermeidung von Kreditverschlechterungen – gut aufgestellt sind, um von der erhöhten Volatilität zu profitieren.

Nach dem starken Rückgang festverzinslicher EM-Wertpapiere im vergangenen Jahr sind die Aussichten für diese Anlageklasse im Jahr 2023 unserer Meinung nach positiver. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen. Wir gehen davon aus, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflation weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde. In Anbetracht der aktuellen Renditeniveaus für EM-Hartwährungsanleihen vertreten wir die Ansicht, dass diese Risiken gut kompensiert werden. Wir halten die Bewertungen für EM-Anleihen mit einer kurzen Duration für attraktiv.

<sup>1</sup>Investment Grade: Bloomberg Global Aggregate Corporate Index

<sup>2</sup>Ohne Investment Grade: Bloomberg Global High Yield Corporate Index

## Global Equity Megatrends – Berichts des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -13,78 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum -18,14 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Das vergangene Jahr hat uns einmal mehr den Wert unseres Anlageprozesses vor Augen geführt. Ein Prozess, der als Konzept anerkennt, dass Wirtschafts- und Marktzyklen in hohem Maße unvorhersehbar sind, und der daher die Bedeutung des „Investierens durch den Zyklus“ betont. Es sind die einzigartigen Elemente und die dogmatische Anwendung unseres Prozesses, die es uns ermöglicht haben, während der Volatilität des Jahres 2022 unseren Fokus zu wahren, und die unseren derzeitigen Optimismus – trotz der makroökonomischen Gegenströme in den kommenden Tagen – untermauern.

Das Jahr 2022 war für die Anleger besonders herausfordernd. Mit dem Ende der COVID-Ära begannen viele der monetären Beschleuniger, die der Wirtschaft in den letzten zehn Jahren zugeführt worden waren, sich in die entgegengesetzte Richtung zu bewegen. Die Auswirkungen dieser Kräfte auf den Markt und die Wirtschaft waren, ähnlich wie in den Jahren 2020 und 2021, außerordentlich heftig und schnell, denn die in den letzten zwölf Jahren in beispiellosem Umfang in die Wirtschaft injizierte Liquidität wurde nun zügig wieder aus dem System abgezogen. Im Jahr 2009 kamen die Zentralbanken weltweit zu dem Schluss, dass das politische Rezept zur Bekämpfung der Kreditkrise im Kern der globalen Finanzkrise darin bestand, Liquidität zuzuführen. Während sich die globalen Volkswirtschaften bis 2018 weitgehend erholt hatten, veranlasste der Ausbruch der COVID-Pandemie die Zentralbanken dazu, die Geldmenge weiter zu erhöhen und die Zinssätze für längere Zeit auf ein historisch niedriges Niveau zu senken. Das Endergebnis, wie wir in unseren Mitteilungen zum Jahresende 2020 und 2021 hervorgehoben haben, war eine Verzerrung der Märkte für festverzinsliche Wertpapiere und der Aktienbewertungen, eine unhaltbare Risikobereitschaft und eine höhere Inflation. Diese Herausforderungen wurden im vergangenen Jahr durch die anhaltenden durch COVID bedingten Verzerrungen in der Lieferkette, den Krieg in der Ukraine und eine verpatzte Null-COVID-Politik in China noch verstärkt. Die folgende Risikoaversion war natürlich, und der Zugang zu Kapital trocknete schnell aus. Um das Ausmaß der Risikoaversion mit einer Statistik zu verdeutlichen: Im Jahr 2022 gingen die Erlöse aus Börsengängen in den USA gegenüber 2021 um 95 % zurück.

Vor diesem Hintergrund sahen sich Aktienanleger mit jährlichen Verlusten konfrontiert, wie sie sie seit der großen Finanzkrise von 2008 nicht mehr erlebt hatten. Öl im Feuer war, dass die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere negative Rekordrenditen verzeichneten, was die Asset-Allokation-Modelle, auf die sich die meisten Finanzinstitute verlassen, in Frage stellt. Auch wenn dies bedrückend erscheint, sollten die Anleger nicht vergessen, dass diese Verluste auf mehrere Jahre positiver Renditen folgen: Das Portfolio weist eine 3-jährige Gesamrendite von 5,09 % auf, und der MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) hat in demselben Zeitraum eine Gesamrendite von 4,94 % verzeichnet.

Wie wir wissen, spiegeln die Renditen der Anleger in einem bestimmten Jahr nicht unbedingt die Performance der zugrunde liegenden Unternehmen wider – und schon gar nicht im Jahr 2022. Auch wenn viele Unternehmen tatsächlich vor Herausforderungen stehen, wissen aufmerksame Marktbeobachter, dass viele Unternehmen in diesem Umfeld recht gut zurechtkommen. Vor allem solche, die von starken globalen Veränderungen betroffen sind, profitieren von einer nachhaltig langfristigen Nachfrage, während wirklich einzigartige Unternehmen stets über eine starke Preissetzungsmacht verfügen. Darüber hinaus haben die Top-Unternehmen in den letzten drei Jahren ihre Geschäftsabläufe erfolgreich angepasst. Sie haben ihre Effizienz gesteigert und ihre Widerstandsfähigkeit selbst in der Abschwungphase erhöht, um auf ein sich ständig veränderndes wirtschaftliches Umfeld zu reagieren. Diese Charakteristika haben es vielen der Unternehmen in unserem Portfolio ermöglicht, ihren Cashflow deutlich zu verbessern, was ihnen die finanzielle Stärke gibt, diese wirtschaftlichen Schwankungen zu ihrem Vorteil zu nutzen, wenn Konkurrenten ins Abseits geraten und die Kosten von Akquisitionen angemessener sind. Darüber hinaus konnten viele der Unternehmen in unserem Portfolio dank dieser finanziellen Stärke die jüngste Marktvolatilität nutzen, indem sie opportunistisch Aktien zu Bewertungen zurückkauften, die sie seit vielen Jahren nicht mehr gesehen hatten.

Thematisch gesehen leisteten unsere Themen Energieeffizienz und Energieinfrastruktur den größten Renditebeitrag, während die Themen Smart Systems und Globaler Verbraucher den stärksten Gegenwind erzeugten. Auf Ebene der Beteiligungen trugen ATI Inc. (Energieeffizienz), ein Hersteller von Spezialmetallen für die Luft- und Raumfahrt, und Paya Holdings (Globaler Verbraucher), ein Anbieter von integrierter Zahlungssoftware, im Jahr 2022 am meisten zur Portfoliopformance bei. Auf der anderen Seite des Spektrums gehörten unterdessen das Online-Reisebüro Expedia (Globaler Verbraucher) und der Speicherhersteller Western Digital (Smart Systems) zu den größten Verlierern bezüglich der Portfoliorendite.

Wie jedes Jahr im Januar beschäftigen sich die Finanzmedien mit der Frage, was im Jahr 2023 und darüber hinaus „ansteht“. Es überrascht nicht, dass es viele Meinungen gibt, aber nur wenig Überzeugung. Unabhängig von den kurzfristigen makroökonomischen Aussichten und den damit verbundenen Marktschwankungen sind wir vor allem insbesondere zuversichtlich, dass unsere Portfoliounternehmen gut aufgestellt sind, um sich durch die Bandbreite an wahrscheinlichen Ergebnissen zu navigieren. Als Wegbereiter des säkularen Wandels profitieren unsere Unternehmen davon, egal ob der gesamte Kuchen wächst, stagniert oder kleiner wird, dass ihr Stück des Kuchens wächst. Darüber hinaus sind viele unserer Portfoliounternehmen Effizienzverbesserer, die es ihren Kunden ermöglichen, „mehr mit weniger zu erreichen“. Dies ist zwar in jedem Geschäftsumfeld ein wertvolles Angebot, doch ist in Zeiten der Rezession mit einer schrumpfenden Nachfrage und knappen Ressourcen die wirtschaftliche Effizienz von kritischer Bedeutung.



## Global Equity Megatrends – Bericht des Investment-Managers (Fortsetzung)

Wir sind der Ansicht, dass diese Merkmale die Transparenz und Vorhersagbarkeit der Unternehmen im Portfolio erheblich verbessern und in vielen verschiedenen Branchen und Unternehmen weit verbreitet sind. Hier sind einige Beispiele:

- Der Übergang von der traditionellen analogen zur digitalen Werbung wird noch viele Jahre andauern und Unternehmen aller Größenordnungen in die Lage versetzen, Kunden effektiver und effizienter zu erreichen. In unserem Portfolio stehen die Entwickler digitaler Werbesoftware (Ad-Tech-Software) Alphabet, Criteo und Zeta Global (Smart Systems) im Mittelpunkt dieses Wandels von traditioneller (d. h. weniger effektiver) zu digitaler Werbung.
- Die Umstellung auf digitale Reisebuchungs- und -verwaltungsplattformen, die Reisende während ihrer gesamten Reise effektiver betreuen, befindet sich noch in den Kinderschuhen von Ausarbeitung und Annahme. In unserem Portfolio spielen die Online-Reisebüros Expedia und Despegar.com (Globaler Verbraucher) eine Schlüsselrolle in diesem Wandel.
- Die Konsolidierung in der US-amerikanischen Luftfahrtindustrie im letzten Jahrzehnt hat dazu geführt, dass es immer weniger Anbieter gibt, die eine steigende Zahl von Reisenden und Reisezielen bedienen. Darüber hinaus sind die Kosten für Flugreisen seit den 1980er Jahren um mehr als die Hälfte gesunken, was zum einen auf die neue Generation von Düsenflugzeugen zurückzuführen ist, die nur noch halb so viel Treibstoff verbrauchen wie ihre Vorgänger, und zum anderen auf Fluggesellschaften, die ein effektiveres Ertragsmanagement und effizientere Geschäftsabläufe nutzen. Wir gehen davon aus, dass Delta Airlines (Globaler Verbraucher) bei der Gewinnung von Marktanteilen in einer führenden Rolle sein und gleichzeitig den freien Cashflow in den nächsten zwei Jahren verdoppeln wird.
- Nach der Invasion in der Ukraine war die Finanzierung der Energieunabhängigkeit und des Übergangs zu saubereren Energiequellen noch nie so „sicher“, und wir vermuten, dass die bestehenden Investitionspläne nur durch einen schwerer Abschwung zu bremsen wären. Zu den Unternehmen, die diese Energiewende vorantreiben, gehören in unserem Portfolio auf der Angebotsseite der E&C-Spezialist Quanta Services und Vistra Energy (Energieinfrastruktur) sowie auf der Nachfrageseite der Sensorhersteller TE Connectivity und ATI Inc. (Energieeffizienz).
- Die Einführung von Robotik und Prozessautomatisierung steht noch an den Anfängen, bringt aber bereits bedeutende Effizienzgewinne für alle Arten von Prozessen, sowohl in der Fertigungs- als auch in der Dienstleistungsbranche. Unternehmen, die diesen Megatrend ermöglichen, dürften auch in den kommenden Jahren gut aufgestellt sein. Dazu gehören in unserem Portfolio der Hersteller von Sensoren und Steckverbindern TE Connectivity (Energieeffizienz), Paya Holdings (Globaler Verbraucher) und der Entwickler von Contact-Center-Software NICE (Smart Systems).
- Letztlich sei angemerkt, dass Digitalisierung, Datenanalytik und die unterstützenden Ökosysteme im Mittelpunkt aller dieser Megatrends stehen. Daher dürften auch Cloud-Anbieter, KI-Entwickler und Entwickler von Cybersicherheitssoftware wie Alphabet (Smart Systems), Alibaba (Globaler Verbraucher) und GEN Digital Inc. (Smart Systems) in den kommenden Jahren von einem starken Rückenwind profitieren.

Wirtschaftliche Abschwünge betreffen durchweg alle Unternehmen, doch sind wir der festen Überzeugung, dass Unternehmen, die einen starken, globalen, säkularen Wandel herbeiführen und ihre Kunden durch die Bereitstellung wirklich einzigartiger Produkte und Dienstleistungen bei der Steigerung der Effizienz unterstützen, eine bessere geschäftliche Transparenz und Vorhersehbarkeit bieten. Diese Unternehmen dürften mit am besten positioniert sein, ihren Eigenkapitalwert über den gesamten Zyklus hinweg zu steigern. Wichtig ist, dass wir nur in solche Unternehmen investieren, die unserer Meinung nach eine wirklich attraktive Rendite auf ihr mehrjähriges Potenzial zur Generierung von freiem Cashflow bieten.

Wie immer schätzen wir Ihr anhaltendes Vertrauen und Engagement und wir werden daran arbeiten, es uns auch weiterhin zu verdienen. Wenn wir Ihnen in irgendeiner Weise behilflich sein können, zögern Sie bitte nicht, mit uns Kontakt aufzunehmen.

## Global Flexible Credit Income – Berichts des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -9,91 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere gerieten im Berichtszeitraum unter Druck, da die hartnäckig hohe Inflation, die aggressive geldpolitische Straffung durch die Zentralbanken und die zunehmende Wahrscheinlichkeit einer deutlichen Wachstumsverlangsamung die Zinsen in die Höhe trieben und die Credit-Spreads ausweiteten. Letztere gingen im vierten Quartal teilweise zurück, da die Anlegernachfrage aufgrund attraktiverer Gesamtrenditen anzog. Insgesamt stieg die Rendite auf 10-jährige US-Staatsanleihen im Berichtszeitraum um +236 Bp. Die Renditen 2-jähriger Staatsanleihen mit mittleren Laufzeiten in Deutschland (+275 Bp), dem Vereinigten Königreich (+270 Bp) und Japan (+35 Bp) waren ähnlich hoch. Die Credit-Spreads globaler Unternehmensanleihen mit<sup>1</sup> und ohne<sup>2</sup> Investment Grade weiteten sich im Berichtszeitraum um +50 Bp bzw. +164 Bp.

Vor diesem Hintergrund verbuchte das Portfolio eine negative Rendite für den Berichtszeitraum. Das Engagement des Portfolios in US-amerikanischen und europäischen Hochzinsanleihen, Investment-Grade-Unternehmensanleihen („IG“) sowie Schuldtiteln aus Schwellenländern beeinträchtigte die Performance am stärksten. Die taktische Zinspositionierung und das Engagement in CLOs trugen am meisten zur Wertentwicklung bei.

Nach einem Jahr mit einer massiven weltweiten geldpolitischen Straffung erwarten wir, dass sich die Inflation weiter von ihrem Höchststand entfernen wird. Allerdings wird sie auch im kommenden Jahr und möglicherweise bis ins Jahr 2024 deutlich über dem normalen Niveau und den Zielvorgaben der Zentralbanken bleiben. In den Sitzungen der Zentralbanken und in den Äußerungen der Entscheidungsträger kam zum Ausdruck, dass sie zur Dämpfung des Preisdrucks eine straffe Geldpolitik beibehalten müssen. Obwohl wir nur noch einige weitere Zinserhöhungen erwarten, werden die US-Zinsen am kurzen Ende unseres Erachtens noch einige Zeit hoch bleiben. Mit anderen Worten: Die Welt der Nullzinsen, so dominierend nach der globalen Finanzkrise, ist wahrscheinlich vorbei.

Wir sind der Meinung, dass die US-Notenbank einen Großteil ihrer schweren Arbeit abgeschlossen hat und erwarten, dass die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere im Jahr 2023 ruhiger sein werden. Unserer Ansicht nach könnte dies eine große Chance bieten, höhere Renditen bei begrenztem Risiko zu erzielen. Dies umso mehr angesichts des zusätzlichen Renditepolsters, das durch die letztjährige Neubewertung geschaffen wurde. Unsere größte Begeisterung ist in diesem Zusammenhang dem IG-Markt zugeordnet.

Wir gehen davon aus, dass sich die Zinssätze in einer viel engeren Spanne bewegen werden als im Jahr 2022, da die Inflation nachlässt und die Zentralbanken ihre Zinsen schrittweise anheben. Wir glauben, dass das Durationsengagement weniger riskant sein dürfte als 2022. Die grundsätzlichen Bedenken hinsichtlich Unternehmensanleihen dürften jedoch zunehmen, und zwar nicht nur aufgrund der makroökonomischen Entwicklungen, sondern auch in Abhängigkeit von der Dynamik und der Finanzlage der einzelnen Emittenten. Die Einzeltitelauswahl ist in der Folge wichtiger denn je.

Trotz des Potenzials für eine wirtschaftliche Verschlechterung in diesem Jahr ist das Ausfallszenario unserer Ansicht nach relativ günstig. Der Verschuldungsgrad der Unternehmen ist allgemein niedriger und die Liquiditätsbestände sind höher als vor der Pandemie. Die Muster bei den Neuemissionen waren weniger aggressiv, sowohl was die Verwendung der Erlöse als auch die Ratingkategorien betrifft. Darüber hinaus konnten viele Unternehmen aufgrund der extrem niedrigen Renditen der letzten Jahre ihre Laufzeiten zu niedrigen Zinssätzen verlängern, wodurch in den Jahren 2023 und 2024 nur noch relativ wenige Anleihen fällig werden. Dessen ungeachtet besteht der allgemeine Konsens, dass es 2023/2024 zu einem Anstieg der Ausfälle bei Hochzinsanleihen kommen wird, insbesondere wenn die Rezession unerwartet schlimm ausfällt.

Was bedeutet das für die Portfoliositionierung an den Märkten für Unternehmensanleihen? Die Differenzierung im Kreditbereich wird zunehmen, sobald sich die Auswirkungen höherer Zinsen und einer langsameren Konjunktur in den tatsächlichen Unternehmensgewinnen und -ergebnissen niederschlagen werden. Wir denken, dass sich die Märkte für Unternehmensanleihen im Jahr 2022 eher von „Makro-Ergebnissen“ geprägt zu einem stärker von fundamentalen Ergebnissen geprägten Szenario entwickeln werden. Ein wichtiger Unsicherheitsfaktor ist die Frage, ob die gemischte wirtschaftliche Entwicklung zu mehr Inflation als erwartet führen könnte und damit zu mehr Schwierigkeiten an den Finanzmärkten. Dies ist nicht unser Basisszenario, es muss aber in Betracht gezogen werden, da wir uns immer noch auf unsicherem Terrain bewegen.

<sup>1</sup> Investment Grade: Bloomberg Global Aggregate Corporate Index

<sup>2</sup> Ohne Investment Grade: Bloomberg Global High Yield Corporate Index

## Global High Yield SDG Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -11,16 %. Der ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -11,38 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

In einem für die meisten festverzinslichen und aktienbasierten Anlageklassen turbulenten Jahr beendete der Markt für globale Hochzinsanleihen den Berichtszeitraum mit negativen Renditen. Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine, die erhöhte Inflation und hohen Rohstoffpreise, die Verschärfung der finanziellen Bedingungen und die Verlangsamung der Wirtschaftstätigkeit trugen zu der allgemein risikoscheuen Stimmung bei. Robuste Verbraucherausgaben und ein angespannter Arbeitsmarkt, die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine und andere Faktoren haben die Inflation in den USA auf ein 40-jähriges Hoch getrieben. Vor diesem Hintergrund begannen die US-Notenbank im März 2022 mit aggressiven Zinserhöhungen. Sie werden sich voraussichtlich fortsetzen, bis die Inflation unter Kontrolle ist. Die Credit-Spreads globaler Hochzinsanleihen weiteten sich aufgrund von Phasen mit Risikoaversion und der geldpolitischen Strafungsmaßnahmen der Zentralbanken aus. Die Renditen 10-jähriger US-Staatsanleihen und anderer richtungsweisender längerfristiger Staatsanleihen tendierten 2022 aufwärts, da das nominale BIP-Wachstum robust blieb und die Inflation in vielen Ländern den seit mehreren Jahren höchsten Stand erreicht hat. Diese Art von Umfeld hat die Verbesserung oder Stabilität der Fundamentaldaten der meisten globalen Unternehmensanleihen nicht aufgehalten, da viele in einer Position waren, Preiserhöhungen weiterzugeben und sich an das neue Geschäftsumfeld anzupassen. Die Differenzierung im Kreditbereich war auch im Jahr 2022 ein vorherrschender Faktor. Darüber hinaus sanken die Ausfallquoten in der ersten Hälfte des Jahres 2022 auf ein Allzeittief und stiegen dann in der zweiten Jahreshälfte nur geringfügig an. Außerdem waren höhere Renditen und bessere Bewertungen ein Anziehungspunkt für die Anleger in die Anlageklasse der Hochzinsanleihen.

Im globalen Hochzinssegment verzeichneten Wertpapiere mit geringerer Qualität, wie die mit einem Rating von CCC und darunter im ICE BofA Global High Yield Index, (Total Return, abgesichert, USD) mit Renditen von -14,33 %. Wertpapiere mit einem Rating von BB und B rentierten indessen mit -10,89 % bzw. -11,56 % eine Underperformance für das Gesamtjahr. Im Vergleich dazu belief sich die Gesamrendite des Index auf -11,38 %.

Die Ausfallraten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern dürften deutlich unter dem Durchschnitt bleiben, haben sich aber seit den gegen Anfang 2022 erreichten historischen Tiefstständen nach oben bewegt. Die Ausfälle in Schwellenländern („EM“) nehmen zwar zu, aber wir konzentrieren uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit höherem Risiko. Im Dezember lag die paritätisgewichtete 12-monatige Ausfallrate für US-Hochzinsanleihen bei 0,84 % und blieb damit gegenüber dem Vormonat unverändert. Dies war der fünfte Monat in Folge ohne Ausfälle bei US-Hochzinsanleihen, was bisher einmalig ist. Obwohl die Ausfallrate von dem Tiefstand angestiegen ist, rechnen wir aufgrund unserer Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (50 % der Emittenten mit Kreditratings von BB) mit Ausfällen unter dem Durchschnitt, weniger aggressiven Neuemissionen und weniger kurzfristigen Fälligkeiten bei Hochzinsanleihen sowie mit einem Energiesektor im Anleihssegment ohne Investment Grade, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen. Zum Vergleich beträgt die langfristige durchschnittliche Ausfallquote für US-Hochzinstitel 3,2 % (gestützt auf die jährlichen Ausfallquoten bis 1980 laut JP Morgan). In Bezug auf hochverzinsliche Unternehmensanleihen aus Schwellenländern dürfte die Ausfallrate in diesem Jahr weit in den zweistelligen Bereich ansteigen. Grund dafür sind das hohe Risiko der Nichtzahlung seitens russischer und ukrainischer Emittenten und die gestiegenen Ausfälle in Chinas Immobiliensektor. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen lag die Ausfallquote für hochverzinsliche EM-Unternehmensanleihen im Jahr 2022 bei lediglich 1,8 %, da die EM-Unternehmen in diese Phase der Wachstumsverlangsamung mit einer im Durchschnitt angemessenen Liquidität eintraten. Der Ausblick für die EM-Ausfälle 2023 ohne Russland, die Ukraine und den chinesischen Immobiliensektor ist positiv, aber immer noch in einem relativ günstigen Bereich.

Im Verlauf des Berichtszeitraums trugen die Einzeltitelauswahl im Sektor der diversifizierten Finanzdienste und die Übergewichtung und Einzeltitelauswahl im Segment Gasdistribution sowie die Einzeltitelauswahl und Übergewichtung von Support-Dienstleistungen am meisten zur Wertentwicklung bei. Innerhalb der Rating-Positionierung des Portfolios trugen die Wertpapierauswahl in mit BB, CCC und darunter gerateten Papieren sowie eine Untergewichtung von Titeln mit BBB und darüber am meisten zur Performance bei. Demgegenüber waren die Titelauswahl und Untergewichtung von mit B gerateten Papieren, eine Übergewichtung von Titeln mit BB-Rating, eine Untergewichtung und die Titelauswahl von Papieren ohne Rating und die Übergewichtung von CCC und schlechter bewerteten Emittenten für die meisten Abzüge von der Performance verantwortlich.

Die Spreads globaler Hochzinsanleihen weiteten sich 2022, doch wir denken, dass die Bewertungen die Anleger für die unter dem Durchschnitt liegenden Ausfallaussichten mehr als entschädigen. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hat zu einer Verlangsamung des realen BIP-Wachstums geführt, während die nachlassende Nachfrage dazu beigetragen hat, dass die Inflation etwas abkühlt. Sie liegt allerdings immer noch über den Zielvorgaben der Zentralbank. Die Normalisierung der Lieferketten und Veränderungen im Verbraucherverhalten dürften neben anderen Faktoren den Aufwärtsdruck auf die Inflation weiter mildern, was letztendlich zu einem weniger aggressiven Kurs der Zentralbankpolitik führen könnte. Unsere Analysten konzentrieren sich jedoch weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Die relative Gesundheit auf Verbraucherseite und ebenso gesunde Unternehmensbilanzen sowie ein wachsendes nominales BIP dürften die Fundamentaldaten der Emittenten weiterhin unterstützen. Während sich die Lagerbestände infolge der nachlassenden Nachfrage wieder füllen, konzentrieren wir uns weiterhin auf sektorspezifische Dynamiken und idiosynkratische Risiken für einzelne Emittenten. Trotz der kurzfristigen Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum und die gestraffte Geldpolitik der Zentralbanken ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Kreditverschlechterungen und die Aufnahme in das Portfolio der ausnahmslos „besten Ideen“ – gut aufgestellt sind, um von der erhöhten Volatilität zu profitieren.

## Global High Yield Sustainable Action – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamrendite der Anteilnehmer der Thesaurierenden Klasse USD I auf -11,49 %. (Die Performance für alle Anteilnehmer ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Wir sind davon überzeugt, dass eine Strategie des konsistenten Engagements mit den Emittenten des Portfolios zu dem effektivsten Dialog und ultimativ zu einer größeren Wahrscheinlichkeit erfolgreicher Ergebnisse führt. Ein weiterer Vorteil eines konsistenten Engagements sind die langfristigen Beziehungen, die im Laufe der Zeit zwischen unserem Researchteam und der Unternehmensleitung aufgebaut werden. Wir denken, dass diese vertrauensvollen Beziehungen in dem dynamischen Umfeld, in dem wir heute leben, besonders wertvoll sind. Wir haben festgestellt, dass wir durch den Aufbau enger Beziehungen zu Führungskräften besser in der Lage sind, Veränderungen im Laufe der Zeit zu beeinflussen. Während des Berichtszeitraums stellten wir den Dialog mit den Emittenten weiterhin einen wichtigen Schwerpunkt beim Portfoliomanagement dar. Die Analysten konzentrieren sich auf die Kommunikation mit führenden Mitgliedern der Geschäftsführung, um Produkte und Serviceleistungen mit den für die jeweilige Branche („SDG“) relevanten Zielen einer nachhaltigen Entwicklung in Einklang zu bringen. Uns ist ferner bewusst, dass die SDG und die Gesamtauswirkung des Portfolios zusammen mit der Anlageperformance wichtige Überlegungen sind. Die Daten deuten darauf hin, dass Unternehmen, die „das Richtige tun“, auch zu einer langfristig guten Performance tendieren. Es zeigt sich, dass die Widerstandsfähigkeit von Unternehmen auch dadurch unterstützt wird, wie gut das Management ESG- und SDG-Faktoren in den Betrieb ihrer Unternehmen integriert.

In einem für die meisten festverzinslichen und aktienbasierten Anlageklassen turbulenten Jahr beendete der Markt für globale Hochzinsanleihen den Berichtszeitraum mit negativen Renditen. Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine, die erhöhte Inflation und hohen Rohstoffpreise, die Verschärfung der finanziellen Bedingungen und die Verlangsamung der Wirtschaftstätigkeit trugen zu der allgemein risikoscheuen Stimmung bei. Robuste Verbraucherausgaben und ein angespannter Arbeitsmarkt, die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine und andere Faktoren haben die Inflation in den USA auf ein 40-jähriges Hoch getrieben. Vor diesem Hintergrund begannen die US-Notenbank im März 2022 mit aggressiven Zinserhöhungen. Sie werden sich voraussichtlich fortsetzen, bis die Inflation unter Kontrolle ist. Die Credit-Spreads globaler Hochzinsanleihen weiteten sich aufgrund von Phasen mit Risikoaversion und der geldpolitischen Strafmaßnahmen der Zentralbanken aus. Die Renditen 10-jähriger US-Staatsanleihen und anderer richtungsweisender längerfristiger Staatsanleihen tendierten 2022 aufwärts, da das nominale BIP-Wachstum robust blieb und die Inflation in vielen Ländern den seit mehreren Jahren höchsten Stand erreicht hat. Diese Art von Umfeld hat die Verbesserung oder Stabilität der Fundamentaldaten der meisten globalen Unternehmensanleihen nicht aufgehalten, da viele in einer Position waren, Preiserhöhungen weiterzugeben und sich an das neue Geschäftsumfeld anzupassen. Die Differenzierung im Kreditbereich war auch im Jahr 2022 ein vorherrschender Faktor. Darüber hinaus sanken die Ausfallquoten in der ersten Hälfte des Jahres 2022 auf ein Allzeittief und stiegen dann in der zweiten Jahreshälfte nur geringfügig an. Außerdem waren höhere Renditen und bessere Bewertungen ein Anziehungspunkt für die Anleger in die Anlageklasse der Hochzinsanleihen.

Das Portfolio hat zwar keine Benchmark, aber der breitere globale Hochzinsmarkt (gemessen am ICE BofA Global High Yield Index) verzeichnete bei Wertpapieren niedrigerer Qualität, beispielsweise Wertpapiere mit einem Rating von CCC und darunter, eine Underperformance mit einer Rendite von -14,33 %, während mit BB und B geratete Wertpapiere mit -10,89 % bzw. -11,56 % rentierten. Im Vergleich dazu belief sich die Gesamrendite des Index auf -11,38 %.

Während des Berichtszeitraums trug die Positionierung des Portfolios in den Bereichen Luft- und Raumfahrt/Verteidigung sowie Druck & Verlagswesen zur Performance und Positionierung bei, während die Positionierung bei Konsumgüterprodukten neutral war. Im Gegensatz dazu beeinträchtigte die Positionierung in den Bereichen Telekommunikation, Immobilien & Bauunternehmen sowie Gesundheitswesen die Performance am stärksten.

Die Ausfallraten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern dürften deutlich unter dem Durchschnitt bleiben, haben sich aber seit den gegen Anfang 2022 erreichten historischen Tiefständen nach oben bewegt. Die Ausfälle in Schwellenländern („EM“) nehmen zwar zu, aber wir konzentrieren uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit höherem Risiko. Im Dezember lag die paritätischgewichtete 12-monatige Ausfallrate für US-Hochzinsanleihen bei 0,84 % und blieb damit gegenüber dem Vormonat unverändert. Dies war der fünfte Monat in Folge ohne Ausfälle bei US-Hochzinsanleihen, was bisher einmalig ist. Obwohl die Ausfallrate von dem Tiefstand angestiegen ist, rechnen wir aufgrund unserer Bottom-up-Bewertung von Emittenten und getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (50 % der Emittenten mit Kreditratings von BB) mit Ausfällen unter dem Durchschnitt, weniger aggressiven Neuemissionen und weniger kurzfristigen Fälligkeiten bei Hochzinsanleihen sowie mit einem Energiesektor im Anleihssegment ohne Investment Grade, der deutlich solider als in den letzten Zyklen ist. Zum Vergleich beträgt die langfristige durchschnittliche Ausfallquote für US-Hochzinstitel 3,2 % (gestützt auf die jährlichen Ausfallquoten bis 1980 laut JP Morgan). In Bezug auf EM-Hochzins-Unternehmensanleihen dürfte die Ausfallrate insgesamt in diesem Jahr weit in den zweistelligen Bereich ansteigen. Grund dafür sind die Nichtzahlung seitens russischer und ukrainischer Emittenten und die erhöhte Zahl an Ausfällen in Chinas Immobiliensektor. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen lag die Ausfallquote für hochverzinsliche EM-Unternehmensanleihen im Jahr 2022 bei lediglich 1,8 %, da die EM-Unternehmen in diese Phase der Wachstumsverlangsamung mit einer im Durchschnitt angemessenen Liquidität eintraten. Der Ausblick für die EM-Ausfälle 2023 ohne Russland, die Ukraine und den chinesischen Immobiliensektor ist positiv, aber immer noch in einem relativ günstigen Bereich.

Die Spreads globaler Hochzinsanleihen weiteten sich 2022, doch wir denken, dass die Bewertungen die Anleger für die unter dem Durchschnitt liegenden Ausfallaussichten mehr als entschädigen. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hat zu einer Verlangsamung des realen BIP-Wachstums geführt, während die nachlassende Nachfrage dazu beigetragen hat, dass die Inflation etwas abkühlt. Sie liegt allerdings immer noch über den Zielvorgaben der Zentralbank. Die Normalisierung der Lieferketten und Veränderungen im Verbraucherverhalten dürften neben anderen Faktoren den Aufwärtsdruck auf die Inflation weiter mildern, was letztendlich zu einem weniger aggressiven Kurs der Zentralbankpolitik führen könnte. Unsere Analysten konzentrieren sich jedoch weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Die relative Gesundheit auf Verbraucherseite und ebenso gesunde Unternehmensbilanzen sowie ein wachsendes nominales BIP dürften die Fundamentaldaten der Emittenten weiterhin unterstützen. Während sich die Lagerbestände infolge der nachlassenden Nachfrage wieder füllen, konzentrieren wir uns weiterhin auf sektorspezifische Dynamiken und idiosynkratische Risiken für einzelne Emittenten. Trotz der kurzfristigen Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum und die gestraffte Geldpolitik der Zentralbanken ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Kreditverschlechterungen und die Aufnahme in das Portfolio der ausnahmslos „besten Ideen“ – gut aufgestellt sind, um von der erhöhten Volatilität zu profitieren.

## Global Investment Grade Credit – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -14,57 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, abgesichert, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Minus von -14,11 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist in Anhang II aufgeführt.) Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

In den ersten neun Monaten des Jahres 2022 wurden Unternehmensanleihen mit Investment Grade durch die russische Invasion in der Ukraine am 24. Februar vor Probleme gestellt, was zu höheren Rohstoffpreisen führte. Ferner stiegen die Inflationsraten im Laufe des Jahres weiter an, da die Zentralbanken ihre Geldpolitik rasch anpassten. Im Laufe des Jahres erhöhte die US-Notenbank (die „Fed“) das Zielband für die Leitzinsen um 425 Basispunkte auf 4,25 % bis 4,50 %, was sich erheblich auf die Marktvolatilität und die Kreditspreads auswirkte. Nach der russischen Invasion in der Ukraine stiegen die Gaspreise in Europa erheblich an, und die Gaslieferungen über die Nord-Stream-Pipeline nach Europa kamen im dritten Quartal zu einem Ende. Während die Fundamentaldaten der Emittenten von Unternehmensanleihen stark blieben, da die Unternehmen ihre Preissetzungsmacht aufrechterhielten und die Kosteninflation weitergaben, führten die geopolitischen Entwicklungen, die Straffung der Geldpolitik und die Bedenken hinsichtlich der Energieversorgung in Europa zu einer erheblichen Ausweitung der Credit-Spreads. Die Spreads begannen sich ab Mitte November zu erholen, nachdem die Daten zur Verbraucherpreisinflation in den USA und der EU im Oktober hinter den Erwartungen zurückblieben. Die Stimmung gegenüber Europa verbesserte sich im vierten Quartal ebenfalls, da die Gaspreise in Europa aufgrund des warmen Wetters, der hohen Gasspeicherbestände und der Sparmaßnahmen zur Senkung des Verbrauchs in den Mitgliedstaaten gegenüber dem Höchststand vom August deutlich nachgaben.

Die Titelauswahl in den Bereichen Banken und Technologie/Kommunikation war der positiven Performance des Portfolios zuträglich. Die Asset-Allokation in Form unserer Untergewichtung des Finanzsektors gegenüber dem Index leistete ebenfalls positive Performancebeiträge. Unsere Asset-Allokation in Nicht-Basiskonsumgütern und Basiskonsumgütern (beide untergewichtet) beeinträchtigte die Wertentwicklung.

Die Spreads haben sich verengt, da die Inflation und andere Wirtschaftsdaten auf die Möglichkeit einer sanften Landung und eine geringere Wahrscheinlichkeit für eine Rezession hindeuten. Wir gehen davon aus, dass die Fed die Zinssätze im Laufe des ersten Quartals 2023 weiter anheben wird, wenn auch in einem mehr moderaten Tempo. Angesichts der restriktiven Geldpolitik erwarten wir, dass sich das makroökonomische Umfeld Anfang 2023 angesichts der verschärften Finanzbedingungen deutlich abschwächen wird. Wir denken, dass sich der Arbeitsmarkt abschwächen und die Ertragslage der meisten Unternehmen im Laufe des Jahres schwieriger werden wird. Dies könnte zwar die Risikobereitschaft der Anleger dämpfen, doch sollten die attraktiven Marktrenditen in Verbindung mit historisch starken Kreditkennzahlen der Nachfrage und den Kreditrisikoprämien hilfreich sein. Wir gehen davon aus, dass die Inflation im weiteren Jahresverlauf deutlich sinken wird, die US-Notenbank die weitere Straffung der Geldpolitik wahrscheinlich aussetzt und ihren Leitzins für den Rest des Jahres im restriktiven Bereich belässt. Wir denken, dass das Wirtschaftswachstum höchstwahrscheinlich unter dem Trend liegen wird, was die Credit-Spreads potenziell anfällig für eine Ausweitung macht, da sich die Fundamentaldaten von Unternehmensanleihen leicht verschlechtern. Im weiteren Jahresverlauf, wenn sich die Inflation weiter abschwächt und sich die Fundamentaldaten von Unternehmensanleihen stabilisieren, dürfte sich die Unterstützung der Anleger für diese Instrumente verbessern, und die Spreads sollten sich in der zweiten Jahreshälfte verengen. Wir gehen davon aus, dass das Angebot auf dem Primärmarkt ähnlich hoch sein dürfte wie 2022, was vom Markt gut absorbiert werden sollte.

Zum Jahresstart 2023 bleiben wir übergewichtet in einigen der mehr defensiven Sektoren wie Kommunikationsdienste, Versorger und Banken sowie in einigen zyklischen Sektoren mit höherem Beta wie Finanzen, REITs und zyklische Konsumgüter. Wir bleiben bei unserer Übergewichtung von Sektoren, die starke Fundamentaldaten haben und sich derzeit im Verschuldungsabbau befinden, wie Kommunikationsdienste und auch Banken, die unseres Erachtens von einem Umfeld steigender Zinsen profitieren sollten. Wir sind untergewichtet in Sektoren wie nicht-zyklische Konsumgüter, die wir für stärker gefährdet einschätzen, Fremdkapital zur Finanzierung von Aktionärsrenditen über Aktienrückkäufe und M&A-Aktivitäten einzusetzen und die zu relativ angespannten Bewertungen gehandelt werden.

## Global Opportunistic Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -11,44 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, abgesichert, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Minus von 11,22 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere gerieten im Berichtszeitraum unter Druck, da die hartnäckig hohe Inflation, die aggressive geldpolitische Straffung durch die Zentralbanken und die zunehmende Wahrscheinlichkeit einer deutlichen Wachstumsverlangsamung die Zinsen in die Höhe trieben und die Credit-Spreads ausweiteten. Letztere gingen im vierten Quartal teilweise zurück, da die Anlegernachfrage aufgrund attraktiverer Gesamtrenditen anzog. Insgesamt stieg die Rendite auf 10-jährige US-Staatsanleihen im Berichtszeitraum um +236 Basispunkte („Bp“). Die Renditen 2-jähriger Staatsanleihen mit mittleren Laufzeiten in Deutschland (+275 Bp), dem Vereinigten Königreich (+270 Bp) und Japan (+35 Bp) waren ähnlich hoch. Die Credit-Spreads globaler Unternehmensanleihen mit<sup>1</sup> und ohne<sup>2</sup> Investment Grade weiteten sich im Berichtszeitraum um +50 Bp bzw. +164 Bp.

Was die relative Performance betrifft, so war die Zinspositionierung des Portfolios im Berichtszeitraum mehr oder weniger neutral. Die untergewichteten Engagements in US-amerikanischen, kerneuropäischen und kanadischen Zinssätzen trugen erheblich zur Performance bei, doch wurden diese positiven Effekte durch übergewichtete Engagements in australischen und neuseeländischen Zinssätzen wettgemacht. In Hinsicht auf Unternehmensanleihen beeinträchtigte das Engagement des Portfolios in Schuldtiteln aus Schwellenländern („EM“) die Performance am stärksten, während die Wertpapierauswahl bei globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade für geringere Wertabzüge verantwortlich zeichnete. Das Engagement des Portfolios in globalen Hochzinsanleihen, die Untergewichtung von globalen Investment-Grade-Unternehmensanleihen und Kreditrisikotransfers trugen am meisten zur Performance bei. Unsere aktive Devisenstrategie war im Berichtszeitraum negativ: Die Positionierung im Schweizer Franken und im Pfund Sterling war positiv, doch hatte die Positionierung im japanischen Yen und der norwegischen Krone einen negativen Effekt.

Nach einem Jahr mit einer massiven weltweiten geldpolitischen Straffung gehen wir davon aus, dass sich die Inflation weiter von ihrem Höchststand entfernen wird. Allerdings wird sie auch im kommenden Jahr und bis ins Jahr 2024 deutlich über dem normalen Niveau und den Zielvorgaben der Zentralbanken bleiben. In den Sitzungen der Zentralbanken und in den Äußerungen der Entscheidungsträger kam zum Ausdruck, dass sie zur Dämpfung des Preisdrucks eine straffe Geldpolitik beibehalten müssen. Obwohl es also noch zu einigen weiteren Zinserhöhungen kommen könnte, werden die US-Zinsen am kurzen Ende unseres Erachtens noch einige Zeit hoch bleiben. Mit anderen Worten: Die Welt der Nullzinsen, so dominierend nach der globalen Finanzkrise, ist wahrscheinlich vorbei.

Wir sind der Meinung, dass die US-Notenbank einen Großteil ihrer schweren Arbeit abgeschlossen hat und erwarten, dass die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere im Jahr 2023 ruhiger sein werden. Unserer Ansicht nach könnte dies eine große Chance bieten, höhere Renditen bei begrenztem Risiko zu erzielen. Dies umso mehr angesichts des zusätzlichen Renditepolsters, das durch die letztjährige Neubewertung geschaffen wurde. Unsere größte Begeisterung ist in diesem Zusammenhang dem Investment-Grade-Markt zugeordnet.

Wir gehen davon aus, dass sich die Zinssätze in einer viel engeren Spanne bewegen werden als im Jahr 2022, da die Inflation nachlässt und die Zentralbanken ihre Zinsen schrittweise anheben. Wir glauben, dass das Durationsengagement weniger riskant sein dürfte als 2022. Die grundsätzlichen Bedenken hinsichtlich Unternehmensanleihen dürften unserer Meinung nach jedoch zunehmen, und zwar nicht nur aufgrund der makroökonomischen Entwicklungen, sondern auch in Abhängigkeit von der Dynamik und der Finanzlage der einzelnen Emittenten. Die Einzeltitelauswahl ist in der Folge wichtiger denn je. Trotz des Potenzials für eine wirtschaftliche Verschlechterung in diesem Jahr ist das Ausfallszenario unserer Ansicht nach relativ günstig. Der Verschuldungsgrad der Unternehmen ist allgemein niedriger und die Liquiditätsbestände sind höher als vor der Pandemie. Die Muster bei den Neuemissionen waren weniger aggressiv, sowohl was die Verwendung der Erlöse als auch die Ratingkategorien betrifft. Darüber hinaus konnten viele Unternehmen aufgrund der extrem niedrigen Renditen der letzten Jahre ihre Laufzeiten zu niedrigen Zinssätzen verlängern, wodurch in den Jahren 2023 und 2024 nur noch relativ wenige Anleihen fällig werden. Dessen ungeachtet herrscht die Konsensmeinung vor, dass es 2023/2024 zu einem Anstieg der Ausfälle bei Hochzinsanleihen kommen kann, insbesondere wenn die Rezession unerwartet schlimm ausfällt.

Was bedeutet das für die Portfoliositionierung an den Märkten für Unternehmensanleihen? Die Differenzierung im Kreditbereich wird zunehmen, sobald sich die Auswirkungen höherer Zinsen und einer langsameren Konjunktur in den tatsächlichen Unternehmensgewinnen und -ergebnissen niederschlagen werden. Wir denken, dass sich die Märkte für Unternehmensanleihen im Jahr 2022 eher von „Makro-Ergebnissen“ geprägt zu einem stärker von fundamentalen Ergebnissen geprägten Szenario entwickeln werden. Ein wichtiger Unsicherheitsfaktor ist die Frage, ob die gemischte wirtschaftliche Entwicklung zu mehr Inflation als erwartet führen könnte und damit zu mehr Schwierigkeiten an den Finanzmärkten. Dies ist nicht unser Basisszenario, es muss aber in Betracht gezogen werden, da wir uns immer noch auf unsicherem Terrain bewegen.

<sup>1</sup>Investment Grade: Bloomberg Global Aggregate Corporate Index

<sup>2</sup>Ohne Investment Grade: Bloomberg Global High Yield Corporate Index

## Global Real Estate Securities – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -25,56 %. Die Benchmark, der FTSE EPRA/Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im gleichen Zeitraum -25,05 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

Der globale Aktienmarkt, gemessen am MSCI All Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD), hat im Berichtszeitraum stark nachgegeben. Dies war auf eine Reihe von Faktoren zurückzuführen, darunter die hohe Inflation, die im Mai in den Vereinigten Staaten den höchsten Stand seit 40 Jahren erreichte. Dies löste eine scharfe Kehrtwende in der Geldpolitik der Zentralbanken aus. Zudem wurde die Stimmung der Anleger durch die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine, Probleme in der Lieferkette und die Möglichkeit, dass die geldpolitischen Straffungsmaßnahmen der Fed die globale Wirtschaft in eine Rezession stürzen könnten, negativ beeinflusst. Insgesamt erzielte der MSCI All Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) in den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2022 eine Rendite von -18,36 %. Dagegen erzielte die Benchmark FTSE EPRA/Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) eine Rendite von -25,05 %.

Im Berichtszeitraum schnitt das Portfolio schlechter ab als der Index. Sowohl die Einzeltitelauswahl als auch die Länderpositionierung trugen insgesamt zu den relativen Ergebnissen bei. Die Bestände des Portfolios in den Sektoren Immobilien-Holdings & Bauträger, Infrastruktur und Büroimmobilien steigerten den Wert am meisten. Umgekehrt beeinträchtigten Positionen in den Sektoren Einlagerung, Einzelhandel und Gesundheitswesen die Performance am meisten. Ein Blick auf die Länderpositionierung zeigt, dass Untergewichtungen von Deutschland und Schweden am meisten zu den relativen Ergebnissen beitrugen. Im Gegensatz dazu wurde die Performance durch eine Übergewichtung im Vereinigten Königreich und einer Untergewichtung in der Schweiz am stärksten ausgebremst.

Zu Beginn des Jahres 2023 sind wir vorsichtig, da das Makro-Umfeld durch die Inflation, eine aggressive US-Notenbank, die entschlossen ist, die Inflation unter Kontrolle zu bringen, ein langsames Wirtschaftswachstum und einen Mangel an Liquidität sowohl an den Transaktionsmärkten als auch bei privaten Anlageinstrumenten belastet wird. Die Weltwirtschaft scheint sich abzuschwächen, was an der Verlangsamung des Wohnungsbaus und das geringe Vertrauen der Unternehmen ablesbar ist. Die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft, niedrigere Energie- und Rohstoffpreise und ein sich abschwächender Arbeitsmarkt könnten die Ansicht unterstützen, dass die Inflation ihren Höhepunkt erreicht hat. Erhöhte Kapitalkosten für REITs, gepaart mit einer wahrscheinlichen Verschlechterung der Fundamentaldaten im Anschluss an eine robuste Vermietungsperiode 2021/2022, werden wahrscheinlich Geschäftsentscheidungen verzögern und die Gesamtnachfrage und das Ertragswachstum von REITs belasten. Unserer Meinung nach werden der Immobiliensektor und die Wertpapierauswahl wichtige Alpha-Beiträge leisten, und zwar mehr als in der Vergangenheit. Wir glauben, dass der Großteil der REITs auf eine erhebliche Störung der Unternehmensnachfrage vorbereitet ist, mit starken Bilanzen, einer relativ geringen Neubautätigkeit und verschiedenen Nachfragefaktoren, die eher defensiven Charakters sind. Die rasche Umkehrung der Mittelbeschaffung bei nicht börsennotierten REITs („NTRs“) und die Welle von Rücknahmeanträgen könnte REITs die Gelegenheit bieten, ausgewählte Vermögenswerte zu relativ attraktiven Bewertungen zu erwerben.

In Übersee erlebten die europäischen Immobilienmärkte im vierten Quartal eine deutliche Erholung. Sowohl die kontinentaleuropäischen Märkte als auch das Vereinigte Königreich erholten sich, da sich die Anleihenmärkte zu erholen begannen und die neue Sunak-Regierung dazu beitrug, die Marktstimmung zu stabilisieren. Die Vermietung und der Verkauf erstklassiger, moderner Londoner Büroimmobilien deuteten an, dass die Nachfrage von Mietern und Investoren nach den besten Objekten weiterhin gut ist. Auf dem Kontinent erholten sich die Kurse von Immobilienaktien von ihren niedrigen Niveaus, da die Verkäufe von notleidenden Vermögenswerten ausblieben und sich die Schuldenmärkte etwas stabilisierten. Es besteht jedoch nach wie vor das Risiko, dass schwächere Unternehmen in 2023 zwecks einer Stärkung ihrer Bilanzen eine stark verwässernde Kapitalerhöhung anstreben werden. Insgesamt sind wir nach wie vor besorgt, dass sich eine Konjunkturabschwächung auf die mehr zyklischen Immobiliensektoren in Europa auswirken könnte, und wir bevorzugen weiterhin Unternehmen in Sektoren mit säkularem Rückenwind, wie Logistik, Selbsteinlagerung und Studentenwohnheime. Die Performance der asiatischen Märkte wurde im vierten Quartal 2022 von der Regierungspolitik beeinflusst. Der entschlossene Schritt Chinas, seine Null-COVID-Politik zu beenden, die Wirtschaft anzukurbeln und gleichzeitig den Immobiliensektor zu unterstützen, führte zu einem deutlichen Aufschwung der Aktien in Hongkong und China. Im Gegensatz dazu kam es bei den Immobilienaktien in Japan zu einem beträchtlichen Rückschlag, nachdem die Bank of Japan die Handelsbandbreite für die Renditen auf 10-jährige Anleihen unerwartet erweitert hatte. Als Reaktion auf die Kehrtwende in der chinesischen Politik haben wir die Gewichtung des Portfolios in Hongkong erhöht und, um die Chancen der Erholung besser nutzen zu können, neue Titel in das Portfolio aufgenommen.

## Global Sustainable Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -28,39 %. Der MSCI EM Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -18,14 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

2022 war ein turbulentes Jahr für die Märkte, das von einer steigenden Inflation, einem aggressiven Zentralbankkurs und geopolitischen Schocks geprägt war. Der Großteil der Wertentwicklung von Vermögenswerten war in diesem Jahr äußerst negativ, da sowohl globale Aktienwerte als auch Anleihen weltweit abgestoßen wurden. Zu Beginn des Jahres war die Inflation bereits aufgrund von angebotsseitigen Problemen auf dem Weg nach oben. Sie hatten sich aus dem wirtschaftlichen Neustart nach der COVID-19-Pandemie ergeben. Der verheerende Einmarsch der russischen Streitkräfte in der Ukraine im Februar hat die Märkte erschüttert, und als die Länder sich eilig daran machten, Sanktionen zu verhängen, stiegen die Lebensmittel- und Energiepreise weiter an. Im Jahr 2022 erreichte die Gesamtinflation einen historischen Höchststand: Der US-Verbraucherpreisindex stieg im Juni um 9,1 % gegenüber dem Vorjahr, und die Zentralbanken begannen mit einer Reihe von Zinserhöhungen, die sowohl im Tempo als auch ihrem Ausmaß unerwartet waren. Insgesamt haben die Zentralbanken der G10-Staaten im Jahr 2022 über 2700 Basispunkte an Zinserhöhungen vorgenommen.

Die Rezessionsrisiken in Europa und im Vereinigten Königreich nahmen weiter zu, da sich die Energiekrise verschärfte und der Dollar gegenüber den wichtigsten Weltwährungen im Jahr 2022 extrem stark war. Im letzten Quartal kam es dann allerdings zu einer deutlichen Trendwende. Die Wirtschaftsaktivitäten Chinas waren aufgrund der Schwäche des Immobilienmarktes und der Beibehaltung der Null-COVID-Politik während des größten Teils des Jahres gedämpft, wobei in vielen Großstädten strenge und dauerhafte Lockdowns in Kraft waren. Im Dezember lockerte Peking jedoch die Kontrollen und signalisierte damit den Beginn der mit Spannung erwarteten Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft. Schließlich überraschte die Bank of Japan gegen Jahresende die Märkte, als sie ihre seit langem verfolgte Kontrolle der Renditekurve änderte, was die weltweiten Anleihenrenditen unter Aufwärtsdruck setzte.

Während des Berichtszeitraums schnitt das Portfolio mit einer Gesamtertragsrendite von -28,39 % schlechter ab als der Index, der auf -18,14 % kam. Trotz einer starken Performance im vierten Quartal 2022 beendete das Portfolio das Jahr im negativen Bereich, wobei die Einzeltitelauswahl und die Asset-Allokation die Performance drückten. Die Titelauswahl und die Übergewichtung von Kommunikationsdiensten beeinträchtigten die Performance, da der Sektor um -36,9 % abrutschte und damit die schlechteste Sektorperformance für das Jahr 2022 verbuchte. Auch eine Nullgewichtung im Energiesektor, der im Jahresverlauf um 46 % zulegen konnte, beeinträchtigte die Wertentwicklung. Eine übergewichtete Position im Gesundheitswesen half allerdings, die Underperformance aus Sicht der Sektorallokation zu mildern. Wie bereits erwähnt, beeinträchtigte nicht nur die Titelauswahl im Bereich der Kommunikationsdienste die Performance, sondern auch die Beteiligungen unter Basiskonsumgütern hatten 2022 Mühe. Die Einzeltitelauswahl im Industriesektor trug jedoch zur Minderung der Underperformance des Portfolios bei. Auf Einzeltitelebene verzeichneten unsere Beteiligungen an Amazon, Alphabet und HelloFresh die schwächste Performance im Jahr 2022, während Titel aus dem Gesundheitswesen wie United Health, Novo Nordisk und Elevance Health einen positiven Performancebeitrag leisteten.

Für Amazon war es ein schwieriges Jahr, und als wir uns dem Jahresende näherten, wurde dem Unternehmen ein schwächerer, durch das sich verschlechternde Makro-Umfeld bedingter Ausblick für das vierte Quartal gegeben. Während sich die Trends im nordamerikanischen E-Commerce gut hielten, wies die Geschäftsleistung auf die sich abschwächenden internationalen Ergebnisse hin. Diese wurden durch das schwächere Verbrauchervertrauen und den Inflationsdruck in Märkten wie Großbritannien und Deutschland verursacht. Trotz dieses kurzfristigen, exogenen Drucks auf das Geschäft des Unternehmens sind wir der Meinung, dass sich an der langfristigen Positionierung und den Chancen von Amazons Einzelhandel und AWS strukturell nichts geändert hat. Amazon erobert durch seinen führenden Einzelhandelservice (Bestandsverfügbarkeit, Preis und schnelle Lieferung) weiterhin Marktanteile. Darüber hinaus verlangsamt sich das Umsatzwachstum von AWS von einer hohen Basis aus zwar kurzfristig, doch sollte die Attraktivität der öffentlichen Cloud von AWS für Unternehmen, die in Zeiten eines Abschwungs nach Effizienzsteigerungen suchen, strukturell an Bedeutung gewinnen (was durch das starke Wachstum der AWS Billings deutlich wird).

Das Team hatte mehrere Gespräche mit den Unternehmen des Portfolios über eine große Auswahl an nachhaltigen Themen, einschließlich der Diversität der Verwaltungsräte. In unserem Gespräch mit dem privaten Vermögensverwalter Partners Group Holding diskutierten wir die nach wie vor starke wirtschaftliche Dynamik. Partners Group präsentierte uns in diesem Zusammenhang sein klares Ziel, im Bereich Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“), die Kohlenstoffemissionen bis 2050 auf Null zu reduzieren. Die Datenerfassung ist jedoch problematisch, da das Unternehmen direkt in 1.000 und indirekt in 14.000 Unternehmen investiert, und die Anwendung allzu strenger Verpflichtungen könnte auch die Anlagegelegenheiten einschränken. Die Aufsicht über die praktische Umsetzung von ESG-bezogenen Plänen bei Partners Group wird an die Verwaltungsräte der kontrollierten Unternehmen delegiert und erfolgt entlang einer von Partners Group erstellten Wesentlichkeitsmatrix. In der Regel helfen externe Berater bei der Umsetzung, da es kleinen Unternehmen oft an den internen Kompetenzen fehlt. Partners Group setzt drei ESG-Ziele pro kontrollierter Beteiligung, die wesentlich und messbar sind. Partners Group verfügt über eine ESG-Integration für alle seine Investitionen, die gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft sind.

Trotz Schwankungen auf dem breiteren Markt, makroökonomischen Entwicklungen oder Schocks wie die COVID-19-Pandemie sind wir davon überzeugt, dass unser Portfolio dank qualitativ hochwertiger Unternehmen, bei denen Nachhaltigkeit ihren Wettbewerbsvorteil stärkt, widerstandsfähig und attraktiv bleibt. Wir konzentrieren uns auf Unternehmen, die (1) eine dauerhafte Wettbewerbsposition haben, die also unserer Meinung nach schwer zu reproduzierende Wettbewerbsvorteile besitzen; (2) keinen Schaden anrichten, d. h. wir glauben, dass sie ESG-Praktiken sorgfältig handhaben; und (3) sich an Veränderungen anpassen, d. h. sie konzentrieren sich unserer Meinung nach auf Innovation und kontinuierliche Verbesserung.

Wir gehen davon aus, dass die Regulierungsbehörden weiterhin auf eine nachhaltigere Entwicklung der Weltwirtschaft drängen werden. Angesichts des schwierigen Markthintergrunds hängt der Erfolg der meisten Qualitätsunternehmen in unseren Augen mehr und mehr von der Entwicklung immateriellen Kapitals ab – innovative Technologie, Forschung & Entwicklung, Humankapital und Marken- oder Plattformreputation –, um eine dauerhafte Wettbewerbsposition zu schaffen. Diese dauerhafte Wettbewerbsposition kann durch eine gute Corporate Citizenship mit einem sorgfältigen ESG-Management gestärkt werden. Wir denken, dass eine vorausschauende Analyse dieser Kombination aus Qualitätsmerkmalen, ESG-Faktoren und idiosynkratischen Merkmalen für die Identifizierung der „Transition Winners“ der neuen Wirtschaft von kritischer Bedeutung ist. Wir denken, dass die Märkte an einem Wendepunkt angekommen zu sein scheinen und das Gleichgewicht zwischen Wachstum und Inflation neu bewerten, da Daten allmählich Anzeichen dafür zeigen, dass die Zentralbankstraffung sich in die Konjunktur einschleicht und das Rezessionsrisiko steigt. Unseres Erachtens wird der künftige Pfad in hohem Maße von der Politik der Zentralbank und dem nachlassenden Inflationsdruck in Richtung des Inflationsziels der Fed abhängen wird.



## High Yield Bond – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -11,84 %. Der ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -11,21 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

In einem für die meisten festverzinslichen und aktienbasierten Anlageklassen turbulenten Jahr 2022 beendete der Markt für Hochzinsanleihen den Berichtszeitraum mit negativen Renditen. Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine, die erhöhte Inflation und hohen Rohstoffpreise, die Verschärfung der finanziellen Bedingungen und die Verlangsamung der Wirtschaftstätigkeit trugen zu der allgemein risikoscheuen Stimmung bei. Robuste Verbraucherausgaben und ein angespannter Arbeitsmarkt, die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine und andere Faktoren haben die Inflation in den USA auf ein 40-jähriges Hoch getrieben. Vor diesem Hintergrund begann die Fed im März 2022 mit aggressiven Zinserhöhungen. Es wird erwartet, dass sie sich voraussichtlich fortgesetzt werden, bis die Inflation unter Kontrolle ist. Die Credit-Spreads von Hochzinsanleihen weiteten sich aufgrund der risikoscheuen Periode und der rasch steigenden Zinsen. Die Renditen 10-jähriger US-Staatsanleihen und anderer richtungsweisender längerfristiger Staatsanleihen tendierten 2022 aufwärts, da das nominale BIP-Wachstum robust blieb und die Inflation in vielen Ländern den seit mehreren Jahren höchsten Stand erreicht hat. Diese Art von Umfeld behinderte nicht die Verbesserung bei Fundamentaldaten von Anleihen für die meisten Hochzinsemittenten, da sie die Preiserhöhungen weitergeben und sich an das neue Betriebsumfeld anpassen konnten. Die Differenzierung im Kreditbereich war auch im Jahr 2022 ein vorherrschender Faktor. Darüber hinaus sanken die Ausfallquoten in der ersten Hälfte des Jahres 2022 auf ein Allzeittief und stiegen dann in der zweiten Jahreshälfte nur geringfügig an. Außerdem waren höhere Renditen und bessere Bewertungen ein Anziehungspunkt für die Anleger in die Anlageklasse der Hochzinsanleihen.

Im Berichtszeitraum erzielten Wertpapiere mit geringerer Qualität, wie die mit einem Rating von CCC und darunter im ICE BofA US High Yield Index, mit Renditen von -16,32 % eine Underperformance. Wertpapiere mit einem Rating von BB und B rentierten indessen mit -10,57 % bzw. -10,58 % im Berichtszeitraum. Im selben Zeitraum verzeichnete der ICE BofA US High Yield Non-Distressed Index ein Minus von 10,61 %, eine Outperformance gegenüber dem Index, während der ICE BofA US High Yield Distressed Index -27,36 % erzielte und damit deutlich hinter dem Index (-11,21 %) deutlich zurückblieb.

Im Dezember lag die paritätsgewichtete 12-monatige Ausfallrate für US-Hochzinsanleihen bei 0,84 % und blieb damit gegenüber dem Vormonat unverändert. Dies war der fünfte Monat in Folge ohne Ausfälle unter Hochzinsanleihen, was bisher einmalig ist. Obwohl die Ausfallrate gegenüber dem Anfang 2022 erreichten Allzeittief von 0,43 % angestiegen sind, rechnen wir aufgrund unserer Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (50 % der Emittenten haben Kreditratings von BB) mit einer unterdurchschnittlichen Zahl an Ausfällen, weniger aggressiven Neuemissionen und weniger kurzfristigen Fälligkeiten bei Hochzinsanleihen sowie mit einem Energiesektor im Anleihssegment ohne Investment Grade, der deutlich solider als in den letzten Zyklen ist. In diesem Zusammenhang sei auf eine Studie von JP Morgan verwiesen, laut der die langfristige durchschnittliche Ausfallrate, basierend auf den jährlichen Ausfallraten seit 1980, bei 3,2 % liegt.

Im Berichtszeitraum trugen die Wertpapierauswahl unter und die Übergewichtung von Gasversorgern, eine Übergewichtung von und die Wertpapierauswahl in diversifizierten Finanzdienstleistungen sowie die Wertpapierauswahl von und eine Übergewichtung in Support-Dienstleistungen am meisten zur Performance bei. Die Einzeltitelwahl im und Übergewichtung des Sektors Medien und Kabel, die Einzeltitelwahl und Übergewichtung von Technologie & Elektronik sowie die Einzeltitelwahl im und die Untergewichtung des Sektors Energie belasteten die Wertentwicklung dagegen am stärksten. Innerhalb der Rating-Positionierung des Portfolios trugen die Wertpapierauswahl in mit BB gerateten Papieren, eine Übergewichtung von Titeln ohne Rating, BBB und darüber und mit BB geratete Emittenten am meisten zur Performance bei. Im Gegensatz dazu zeichneten eine Übergewichtung von und die Titelwahl unter Titeln mit CCC-Rating und darunter, die Einzeltitelwahl unter Titeln mit B-Rating und eine Untergewichtung von BB-Emittenten für die meisten Wertabzüge verantwortlich.

Die Spreads für Hochzinsanleihen weiteten sich im Jahr 2022 aus, doch sind wir der Auffassung, dass die Bewertungen den Anlegern eine attraktive Gelegenheit bieten, insbesondere angesichts unserer unterdurchschnittlichen Ausfallprognose. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hat zu einer Verlangsamung des realen BIP-Wachstums geführt, während die nachlassende Nachfrage dazu beigetragen hat, dass die Inflation etwas abkühlt. Sie liegt allerdings immer noch über den Zielvorgaben der Zentralbank. Die Normalisierung der Lieferketten und Veränderungen im Verbraucherverhalten dürften neben anderen Faktoren den Aufwärtsdruck auf die Inflation weiter mildern, was letztendlich zu einem weniger aggressiven Kurs der Zentralbankpolitik führen könnte. Unsere Analysten konzentrieren sich jedoch weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Die relative Gesundheit auf Verbraucherseite und ebenso gesunde Unternehmensbilanzen sowie ein wachsendes nominales BIP könnten die Fundamentaldaten der Emittenten weiterhin unterstützen. Während sich die Lagerbestände infolge der nachlassenden Nachfrage wieder füllen, konzentrieren wir uns weiterhin auf sektorspezifische Dynamiken und idiosynkratische Risiken für einzelne Emittenten. Trotz der kurzfristigen Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum und die gestraffte Geldpolitik der Zentralbanken ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Kreditverschlechterungen und die Aufnahme in das Portfolio der ausnahmslos „besten Ideen“ – gut aufgestellt sind, um von der erhöhten Volatilität zu profitieren.

## InnovAsia 5G – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtertritte für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -39,36 %. Der MSCI AC World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum -18,36 % (Die Performance für alle Anteilklassen ist in Anhang II aufgeführt). Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertritte erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen.

2022 war ein ungewöhnliches Jahr, das von der höchsten Inflation und den schnellsten Zinserhöhungen der Zentralbanken seit 40 Jahren geprägt war. Das Marktgeschehen drehte sich um die höheren Zinssätze durch die aggressive geldpolitische Straffung durch die Zentralbanken in aller Welt. Die asiatischen Aktienmärkte wurden durch geopolitische Spannungen, COVID-Lockdowns in China und Rezessionsorgen herausgefordert. Dies führte während des Berichtszeitraums zu einer hohen Volatilität und einer schwachen Stimmung am Markt, was wiederum in einer weit verbreiteten Verringerung des Risikos und einer Markttotation weg von Wachstumsaktien resultierte. Beispielsweise verzeichnete der MSCI AC Asia Pacific IT Index im Berichtszeitraum eine Rendite von -32,74 %.

Vor diesem schwierigen makroökonomischen Hintergrund schnitt das Portfolio im Berichtszeitraum schwächer ab als der Index. Nach Sektoren beeinträchtigten Übergewichtungen von Informationstechnologie und von Kommunikationsdienstleistungen die Performance am meisten. Vor allem das Engagement des Portfolios in Bereichen mit hohem Wachstum wie Internet und Mobile Gaming sowie zyklische Sektoren wie Halbleiter verzeichneten eine Underperformance, da diese mit einer Wachstumsnormalisierung und makroökonomischer Schwäche zu kämpfen hatten. Auf der anderen Seite trugen auf Wertpapiererebene führende Halbleiterunternehmen, Hochgeschwindigkeitsnetzwerke und führende Unternehmen im Segment der digitalen Transformation positiv zur Wertentwicklung bei.

Im Jahr 2022 haben wir Wachstumsfallen vermieden und den Schwerpunkt auf Wachstum zu einem angemessenen Preis gesetzt. Wir reduzierten das Engagement in Internet- und Software-Geschäftsmodellen mit hohem Wachstum, durch die schwächere Verbrauchernachfrage beeinträchtigte Unternehmen und in Unternehmen mit schwächeren Aussichten aufgrund einer makroökonomischen Verlangsamung oder geopolitischer Risiken. Dafür stockten wir Positionen in Bereichen mit positiven langfristigen Rückenwinden (Elektrifizierung, erneuerbare Energien, Digitalisierung) und in Bereichen mit strategischer Bedeutung (fortschrittliche Halbleiter) auf. Nach unserer Einschätzung könnte die Konzentration auf die innovativsten kleinen Giganten in Asien mit Wettbewerbsvorteilen und strategischen Partnerschaften die Rendite langfristig vorantreiben.

Mit Blick auf 2023 wird erwartet, dass sich das Tempo der Zinserhöhungen zwar verlangsamen wird, die Zinsen aber noch länger hoch gehalten werden und die makroökonomische Unsicherheit anhalten könnte. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber durchaus bereit, taktische Gelegenheiten zu nutzen und uns für zyklisches Wachstum zu positionieren. Mit der Öffnung der chinesischen Wirtschaft sind wir der Meinung, dass die innovativen kleinen asiatischen Giganten noch attraktiver geworden sind. Wir sind in Bezug auf die Wachstumschancen optimistisch, vor allem bei modernsten Halbleitern, durch robuste Investitionsausgaben bei 5G und Datenzentren sowie die starke Zunahme von digitalen Inhalten und Lifestyle in Asien. Wir bleiben auf die führenden Unternehmen konzentriert und sind bereit, Marktverzerrungen zum Aufbau hochwertiger Positionen, bei denen wir zunehmend positive Aussichten und unsere Anlagethesen bestätigt sehen, zu nutzen.

## Japan Equity Engagement – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse JPY I auf -14,18 %. Der MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 0,77 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Japanische Small-Cap-Aktien entwickelten sich im Berichtszeitraum besser als der größere und breiter gefasste TOPIX Index. Wir sind der Ansicht, dass sich die Aktienkurse kleinerer japanischer Unternehmen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die Binnenwirtschaft als widerstandsfähiger erwiesen haben. Demgegenüber waren größere und stärker exportabhängige Unternehmen mit weltwirtschaftlichen Unsicherheiten konfrontiert, die mit höheren Rohstoffpreisen im Gefolge des militärischen Konflikts in der Ukraine sowie mit der starken Abwertung des japanischen Yen („JPY“) einhergingen, die zu höheren Importkosten beitrug. Zudem wurden durch die anhaltenden Auswirkungen der COVID-19-Pandemie Lieferketten in vielen Branchen, insbesondere in der Automobilindustrie und der industriellen Fertigung, weiterhin unterbrochen. Schließlich betrachtete die globale Anlegergemeinde die Entscheidung der Bank of Japan („BOJ“), ihre Geldpolitik im Hinblick auf die Steuerung der Zinskurve („YCC“) anzupassen, als de facto einen Schritt in Richtung einer geldpolitischen Straffung. Dies führte zu einer Aufwertung des JPY und höheren Zinsen, was wiederum die Aktienkurse größerer exportabhängiger Unternehmen belastete.

Während des Berichtszeitraums blieb das Portfolio hinter dem Index zurück, was in erster Linie auf eine negative Einzeltitelauswahl zurückzuführen ist. Die Kernbestände in den Sektoren Industrie, Nicht-Basiskonsumgüter und Grundstoffe verzeichneten eine schwache Kursentwicklung. In Bezug auf die Sektorallokation beeinträchtigten übergewichtete Positionen von Informationstechnologie und Kommunikationsdiensten sowie traditionelle Nullgewichtung von Basiskonsumgütern die Performance.

Wir denken, dass das wirtschaftliche Wachstum in Japan im kommenden Jahr durch eine Kombination aus robusten Verbraucherausgaben und der Nachfrage aus dem Ausland gestützt wird, welche auch durch die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft Rückenwind erhalten könnte. Was die Inflation anbelangt, so gehen wir von einem allmählichen Anstieg der Verbraucherpreise und Löhne aus. Es bleibt abzuwarten, ob sich daraus ein nachhaltiger Aufwärtstrend entwickeln wird. Wir gehen daher davon aus, dass die BOJ einen schrittweisen Ansatz zur Normalisierung der Geldpolitik verfolgen wird. In unseren Augen wird dies dazu beitragen, die volatilen Bewegungen des JPY im Jahr 2022 zu reduzieren. Ein seit 2022 anhaltender Trend, der unserer Ansicht nach 2023 an Dynamik gewinnen wird, ist die Bemühung japanischer Unternehmen, den Unternehmenswert durch Reformen der Unternehmensführung zu realisieren. Laut den Daten von SMBC Nikko werden japanische Unternehmen während des ersten Quartals 2023 voraussichtlich die Aktionärsrenditen einschließlich der Aktienrückkäufe auf ein Allzeithoch<sup>1</sup> steigern, da die Geschäftsleitungen versuchen, die im Vergleich zu globalen Wettbewerbern geringe Kapitaleffizienz ihrer Unternehmen zu verbessern. Des Weiteren haben die Tokioter Börse („TSE“) und ihre Arbeitsgruppe für Marktreflexionen im Dezember eine neue Beratungsrunde eingeleitet, um das seit langem bestehende Problem der im Vergleich zu den Aktienmärkten der Industrieländer diskontierten Bewertungen japanischer börsennotierter Unternehmen anzugehen. Sie haben in diesem Zusammenhang Vorschläge unterbreitet, u. a. zur Durchsetzung neuer Regeln für Unternehmen, die unter einem Kurs-Buchwert-Verhältnis von 1x gehandelt werden, um mittelfristige Pläne zur Steigerung des Unternehmenswerts offenzulegen<sup>2</sup>. Erwähnenswert ist ebenfalls, dass die Financial Services Agency („FSA“) den Weg für neue Offenlegungspflichten ab April 2024 ebnet. Denen zufolge sind sämtliche börsennotierten Unternehmen verpflichtet, Maßnahmen zur Bewältigung wesentlicher ökologischer und sozialer Probleme wie Klimawandel und Humankapital-Management offenzulegen. Wir halten es für klug, in einem solchen Marktumfeld aktiv die Gewinner zu identifizieren, die von einem fortschrittlichen Management geführt werden, das bereit ist, mit den Anteilhabern zusammenzuarbeiten, um mittel- bis langfristige Werte zu schaffen.

<sup>1</sup> SMBC-Nikko-Daten vom Oktober 2022.

<sup>2</sup> Tokioter Börse, 5. Sitzung der Arbeitsgruppe für Folgemaßnahmen zur Marktreform, 28. Dezember 2022.

## Macro Opportunities FX – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I auf - 2,53 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (EUR Total Return) verzeichnete im selben Zeitraum ein Minus von - 0,94 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Die wichtigsten Währungen mit der besten Performance im Berichtszeitraum waren der US-Dollar und der Schweizer Franken. Der japanische Yen und die schwedische Krone waren die wichtigsten Währungen mit der schwächsten Performance. Im Vergleich zum Index waren Untergewichtungen des Schweizer Frankens und des kanadischen Dollars die am besten abschneidenden Positionen, während sich die Übergewichtung des japanischen Yen und die der norwegischen Krone negativ auf die Performance auswirkten.

Ein großer Teil des Jahres 2022 war von einem erhöhten Inflationsdruck in allen großen Volkswirtschaften und einer aggressiv gestrafften Geldpolitik durch die Zentralbanken geprägt. Der durch den Krieg in der Ukraine verursachte drastische Anstieg der Energie- und Lebensmittelpreise löste die Befürchtung aus, dass eine Energierationierung zu einer Rezession in Europa und dem Vereinigten Königreich führen könnte. Ein milder Winter milderte diese Gefahr. Der Anstieg der Importpreise wirkte sich allerdings auf die europäische Leistungsbilanz aus und ließ den Euro für eine kurze Zeit unter die Parität zum US-Dollar fallen.

Mit Blick auf das Jahr 2023 wird unserer Meinung nach viel davon abhängen, ob der Inflationsdruck weiter nachlässt und ob die Zentralbanken eine mehr neutrale oder sogar gemäßigte Geldpolitik verfolgen. In einem solchen Szenario ist mit einer zunehmenden Divergenz zwischen den Ländern zu rechnen. Zusammen mit den Ungleichgewichten in den Leistungsbilanzen, die durch steigende Energiepreise verursacht werden, könnte dies in unseren Augen zu einer höheren Währungsvolatilität führen.

## Multi-Asset Income – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -11,86 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

2022 war ein turbulentes Jahr für die Märkte, das von einer steigenden Inflation, einem aggressiven Zentralbankkurs und geopolitischen Schocks geprägt war. Mit Ausnahme von Rohstoffen war die Wertentwicklung der Anlagen in diesem Jahr negativ, da globale Aktienwerte und Anleihen gemeinsam abverkauft wurden. Zu Beginn des Jahres war die Inflation bereits aufgrund von angebotsseitigen Problemen auf dem Weg nach oben. Sie hatten sich aus dem wirtschaftlichen Neustart nach der COVID-19-Pandemie ergeben. Der verheerende Einmarsch der russischen Streitkräfte in der Ukraine im Februar hat die Märkte erschüttert, und als die Länder sich eilig daran machten, Sanktionen zu verhängen, stiegen die Lebensmittel- und Energiepreise weiter an. Im Jahr 2022 erreichte die Gesamtinflation einen historischen Stand: Der US-Verbraucherpreisindex stieg im Juni um 9,1 % (im Jahresvergleich), und die Zentralbanken begannen mit einer Reihe von Zinserhöhungen, die sowohl im Tempo als auch ihrem Ausmaß unerwartet waren. Insgesamt haben die Zentralbanken der G10-Staaten im Jahr 2022 über 2700 Bp an Zinserhöhungen vorgenommen. Die Rezessionsrisiken in Europa und im Vereinigten Königreich nahmen mit der Verschärfung der Energiekrise zu, und im September kam es zu einem Absturz auf dem britischen Markt für Staatsanleihen, nachdem die damalige Regierung eine massive und nicht finanzierte Lockerung der Finanzpolitik vorgeschlagen hatte. Das Pfund stürzte ab und fiel auf den niedrigsten Stand gegenüber dem Dollar seit 1985. Tatsächlich zeigte sich der Dollar im Jahr 2022 extrem stark gegenüber den wichtigsten Weltwährungen, obwohl sich der Trend im letzten Quartal deutlich umkehrt hat. Die Wirtschaftsaktivitäten Chinas waren aufgrund der Schwäche des Immobilienmarktes und der Null-COVID-Politik während des größten Teils des Jahres gedämpft, wobei in vielen Großstädten strenge und dauerhafte Lockdowns in Kraft waren. Im Dezember lockerte Peking jedoch die Kontrollen und signalisierte damit den Beginn der mit Spannung erwarteten Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft. Zum Jahresende überraschte die Bank of Japan die Märkte, als sie ihre seit langem verfolgte Kontrolle der Renditekurve änderte, was die weltweiten Anleihenrenditen unter Aufwärtsdruck setzte.

Die Allokation des Portfolios zu Aktien und festverzinslichen Wertpapieren beeinträchtigte die Performance im Laufe des Jahres. Uncorrelated Strategies konnte allerdings einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung leisten, indem die Strategie das Ausmaß der Verluste verringerte und die Volatilität dämpfte. Bei den Aktien war die Performance uneinheitlich. Energieinfrastrukturaktien und die US Systematic Equity Strategy konnten einen gewissen positiven Wertbeitrag generieren, da der Energiesektor überdurchschnittlich abschnitt und die Aktienmärkte eine Stilrotation von Growth zu Value erlebten. Schwellenländeraktien und Nicht-US-Aktienwerte gaben nach, wobei REITs aufgrund der steigenden Zinssätze und zunehmenden Rezessionsängste bei weitem am meisten nachgaben. Die Performance von festverzinslichen Wertpapieren war durch die Reihe negativ, da die Renditen weltweit stiegen und sich die Credit-Spreads ausweiteten. Vorzugspapiere verursachten die meisten Performanceabzüge, da das Universum eine Tendenz zu Wachstumswerten aufweist, die Underperformance verbuchten. Die Optionsstrategie war im Laufe des Jahres rückläufig, da die erhöhte Volatilität die Preise außerhalb des positiven Auszahlungsbereichs bewegte. Es wurden allerdings weiterhin Erträge erzielt. Bei den unkorrelierten Strategien wirkte sich der grundlegende taktische Allokationsprozess des Multi-Asset-Teams ebenso positiv aus wie die strategische Portfolioanpassung, die im Laufe des Jahres vorgenommen wurde und die Portfolioduration reduzierte. Die Währungsstrategie war weitgehend unverändert. Das breitere Mandat des Portfolios und der expansivere Ansatz trugen dazu bei, die Diversität der Engagements zu verbessern und vermied eine starke Underperformance in bestimmten Märkten.

Für die nächsten 12 Monate erwarten wir, dass die Märkte angesichts des verlangsamten Wachstums und der immer noch hohen (wenn auch wahrscheinlich sinkenden) Inflation eine Herausforderung bleiben werden. Das zunehmende Risiko einer weltweiten Rezession und die Entschlossenheit der Zentralbanken, die finanziellen Bedingungen zu verschärfen, machen einen nachhaltigen Anstieg der Aktienmarktbewertungen, eine Verringerung der Credit-Spreads oder einen Rückgang der Anleihenrenditen unserer Meinung nach sehr unwahrscheinlich. Wir glauben, dass der Optimismus unter den Anlegern kurzfristige Erholungen begünstigen kann. Die Sorge vor einer anhaltenden Volatilität veranlasst uns jedoch, defensiven Erträgen und alternativen Diversifikatoren den Vorzug zu geben, um die Volatilität des Portfolios abzuschwächen. Wir bevorzugen Renditen gegenüber dem Aktienrisiko, plädieren im Fall von Aktienwerten für eine defensive Ausrichtung, Qualität und Erträge und betonen die Bedeutung alternativer Diversifikatoren zur Reduzierung der Portfoliovolatilität.

Schließlich sind wir nach wie vor der Ansicht, dass ein mehrdimensionaler Ertragsansatz sinnvoll ist. Im Jahr 2022 wurde die Portfolioperformance insgesamt durch erweiterte Ertragsquellen wie die Energieinfrastruktur und die Nutzung der Strategien Uncorrelated und Absolute Return unterstützt. Wir sind weiterhin auf der Suche nach spezialisierten Ertragsquellen mit einem attraktiven Risiko-Ertrags-Profil. Unser diversifizierter Multi-Asset-Ansatz vermeidet eine Konzentration des Portfoliorisikos bei Aktien, der Duration oder den Spreads und strebt eine Streuung über die verschiedenen Anlageklassen hinweg an, um unter Rahmenbedingungen mit verwaltetem Risiko ein hohes und nachhaltiges Ertragsniveau zu erzielen.

## Next Generation Mobility – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamtertragsrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -26,22 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von -18,36 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Der Index entspricht zwar dem globalen Charakter des Portfolios, deckt aber ein deutlich breiteres Spektrum ab als das Anlageuniversum des Portfolios und eignet sich daher nur bedingt als Vergleichsgröße für die Wertentwicklung. Im Berichtszeitraum schnitt das Portfolio um 786 Basispunkte schwächer ab als der Index. Die Titelauswahl im Sektor Kommunikationsdienste leistete den größten positiven Beitrag zur relativen Performance des Portfolios während des Berichtszeitraums, während die Sektorallokation zu Informationstechnologie die relative Performance am meisten dämpfte. Sektoren ohne Allokation wie Basiskonsumgüter, Energie, das Gesundheitswesen und Versorger hatten einen negativen Einfluss auf die Performance während des Berichtszeitraums.

Die globalen Aktienmärkte schwächten sich im Jahr 2022 deutlich ab. Erhöhte Inflationsraten in vielen Ländern und die anschließende Straffung der Geldpolitik belasteten die globalen Aktienrenditen. Die Renditen stiegen erheblich und der US-Dollar gewann im Laufe des Jahres deutlich an Stärke. Dieses Umfeld hatte einen mehr negativen Effekt auf wachstumsorientierte Titel als auf Werte in den Sektoren Kommunikationsdienste, Nicht-Basiskonsumgüter und Informationstechnologie. Umgekehrt erzielten defensive Sektoren wie Basiskonsumgüter, Gesundheitswesen und Versorger sowie „inflationstolerante“ Sektoren wie Energie, Industrie und Werkstoffe eine bessere relative Performance.

Für die Zukunft sehen wir sowohl Risiken als auch Chancen, und gehen davon aus, dass das makroökonomische Umfeld unbeständig bleiben wird. Eine straffere Geldpolitik wird vermutlich zu einem weltweit langsameren Wirtschaftswachstum führen. Nach einer Lockerung der COVID-Politik wird die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft jedoch einen wichtigen Beitrag zum globalen Wachstum im Jahr 2023 leisten. Der politische Umschwung Chinas könnte ebenfalls positive Entwicklungen für bestimmte Sektoren wie Internet und Halbleiter einleiten, was auch positive Auswirkungen auf andere Volkswirtschaften haben könnte. Thematisch sind wir der festen Überzeugung, dass sowohl autonome Fahrzeuge (AV) als auch Elektrofahrzeuge (EV) im Jahr 2023 trotz eines unbeständigen Makro-Hintergrunds weiter zulegen werden. Folglich sehen wir mit Blick auf 2023 weiterhin attraktive langfristige Anlagegelegenheiten für das gesamte investierbare Universum.

Aus thematischer Sicht entwickelt sich die Transportbranche weiter. Die weltweite Nachfrage nach Batterien für Elektrofahrzeuge wird bis 2023 um mehr als 60 % auf ca. 8 Millionen Einheiten anwachsen und damit etwa 10 % des globalen Fahrzeugmarktes erreichen. Dieses robuste EV-Wachstum ist trotz unsicherer makroökonomischer Bedingungen und der anhaltenden Einschränkungen in der Lieferkette zu beobachten. Wir erwarten aus mehreren Gründen weitere Fortschritte bei der Einführung von Elektrofahrzeugen im Jahr 2023. Wir glauben, dass die politischen Vorgaben weiterhin unterstützend wirken werden und dass die Verabschiedung des Inflation Reduction Acts einen bedeutenden Beitrag zum Wachstum von Elektrofahrzeugen in den USA leisten wird. Hinzu kommt, dass die Automobilhersteller weiterhin viel Geld in die Erweiterung ihres Angebots an Elektrofahrzeugen investieren, was den Verbrauchern eine größere Produktauswahl bieten wird. Indessen erfolgen die unterstützenden Investitionen in die Ladeinfrastruktur, was die Bedenken der Verbraucher in Bezug auf die Reichweite reduzieren sollte. Allgemein stehen wir noch am Anfang in Bezug auf die globale Akzeptanz von batteriebetriebenen Elektrofahrzeugen und wir denken, dass noch ein mehrjähriger Weg vor uns liegt. Auch die Einführung selbstfahrender Fahrzeuge geht weiter voran. Im Jahr 2022 haben die Autohersteller die Einführung fortschrittlicher Fahrerassistenzsysteme (ADAS) weiter vorangetrieben, wie etwa die jüngste Entscheidung von Honda, bis 2030 alle Fahrzeugmodelle in den USA mit Handsfree-Technologie auszustatten. Neben der stärkeren Verbreitung von ADAS konnten wir auch bedeutende Fortschritte bei der Ausgereiftheit dieser Systeme beobachten, so zum Beispiel die Handsfree-Funktion auf Autobahnen und in einigen Fällen in städtischen Gebieten. Wir halten es für wahrscheinlich, dass 2023 und darüber hinaus eine größere Nutzung dieser zunehmend fähigen selbstfahrenden Systeme erfolgen wird. Im Bereich der Robotaxis gehen die Branchenführer von der Forschungs- und Entwicklungs- zur Kommerzialisierungsphase über. So ging 2022 mit GM Cruise in San Francisco ein weiterer kommerzieller Robotaxi-Dienst an den Start. Wir rechnen für 2023 mit größeren kommerziellen Fortschritten, da GM und Googles Waymo ihre Aktivitäten kürzlich auf neue Bereiche ausgeweitet haben.

## Next Generation Space Economy – Berichts des Investment-Managers

Seit der Auflegung am 10. Mai 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -3,90 %. Der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -1,91 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

Während des Berichtszeitraums und generell im Jahr 2022 sahen wir uns mit einer erhöhten wirtschaftlichen Volatilität konfrontiert, eine Folge der rasch steigenden globalen Inflation, höherer Zinssätze, erhöhter Energiepreise, der anhaltenden Auswirkungen von COVID sowie der sich fortsetzenden geopolitischen Spannungen, allen voran Russland/Ukraine. Trotz dieses Drucks gab es gegen Ende des Jahres mehr positive Marktkommentare zu Verbesserungen in der Lieferkette und zu den Bemühungen um eine Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft.

Das Portfolio blieb im Berichtszeitraum hinter dem Index zurück, was primär auf das fehlende Engagement in typischerweise defensiven Sektoren wie Gesundheitswesen, Finanzen und Energie zurückzuführen ist. Teilweise konnte dies allerdings durch unsere positive Aktienauswahl in IT und unsere Positionierung bei Kommunikationsdiensten ausgeglichen wurde. Den größten Performancebeitrag leistete im Berichtszeitraum Safran, denn das Unternehmen profitierte von der allgemeinen Erholung in der Luft- und Raumfahrtbranche. Rocket Lab hingegen verlor im Berichtszeitraum am meisten, da sich die steigenden Zinsen auf die Bewertungen vieler wachstumsstarker Titel auswirkten.

Während wir für das Jahr 2023 mit einer anhaltenden Volatilität am Markt rechnen, während die Anleger versuchen, mit Inflationsdruck und Rezessionsängsten umzugehen, glauben wir in Bezug auf die Weltraumwirtschaft an einem Wendepunkt angelangt zu sein. Angesichts von um mehr als das Zehnfache zurückgehenden Startkosten, Fortschritten bei Satellitentechnologien und höheren kommerziellen Investitionen wird der Weltraum immer zugänglicher und weiter in unser tägliches Leben integriert. Da sich die Weltraumkapazitäten verbessern sind wir überzeugt, dass dies zu einer stärkeren gewerblichen Nachfrage mit zusätzlichen Ertragsströmen führen wird, die eine fortgesetzte Innovation und sogar das Entstehen komplett neuer Unternehmen und Geschäftsmodelle weiter vorantreiben wird.

In der zweiten Jahreshälfte gab es aufregende Ankündigungen im Zusammenhang mit dem Thema Raumfahrt. Die aufsehenerregendste Neuigkeit war die direkte Satelliten-Telefon-Verbindung. Große Unternehmen wie Apple, Qualcomm und T-Mobile kündigten Pläne an, die es handelsüblichen Mobiltelefonen ermöglichen werden, sich mit Satelliten zu verbinden. Nachrichtenberichte, denen zufolge die Technologie bereits mehr als einem Kunden das Leben gerettet hat, unterstrichen nicht nur die Bedeutung dieser Technologie, sondern auch die erwartete Nachfrage seitens der Verbraucher. Darüber hinaus wurden wir Zeuge der ersten erfolgreichen Mission des Artemis-Programms, und die USA machen weiterhin Fortschritte bei der Rückkehr von Menschen auf den Mond und der Einrichtung einer längerfristigen Präsenz. Schließlich gab auch es eine Reihe von Fusionen und Akquisitionen, sowohl von strategischen als auch von finanziellen Käufern. Die beiden wichtigsten Transaktionen waren der Zusammenschluss von OneWeb und Eutelsat sowie der Kauf von Maxar Technologies durch das Private-Equity-Unternehmen Advent International. Zu Beginn des Jahres 2023 sind wir von den Wachstumsaussichten in der Weltraumwirtschaft weiterhin begeistert. Während weltraumgestützte Unternehmen weiterhin ein starkes Wachstum verzeichnen dürften, erwarten wir mehr von terrestrischen Unternehmen und deren Nutzung von weltraumgestützter Technologien zur Verbesserung ihrer Produkte mit Möglichkeiten auf den Agrar-, Finanz- und Kommunikationsmärkten zu hören.

## Short Duration Emerging Market Debt – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -7,09 %. Der ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 1,46 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Dies war eine äußerst turbulente Zeit für Schwellenländer („EM“), die mit den anhaltenden Risiken durch COVID-19 – insbesondere in China, wo die Behörden den größten Teil des Jahres an einer rigiden Politik festhielten – in Kombination mit Russlands Einmarsch in der Ukraine, mit einer hartnäckig hohen Inflation, die zur aggressivsten Straffung der Geldpolitik seit Jahrzehnten führte, und mit einem stärkeren Dollar konfrontiert waren. So kam es zu einem starken Anstieg der Leitzinsen, einer Ausweitung der Spreads in den Schwellenländern und einer hohen Ausfallquote sowohl bei Staats- als auch bei Unternehmensanleihen. Das Ergebnis waren negative Renditen für die Anlageklasse. Dieser Druck auf die Märkte ging gegen Ende des Jahres etwas zurück, da der nachlassende Preisdruck in den USA und der Eurozone das Thema der Rekordinflation unterstützte. Hilfreich wirkten sich zudem die Anzeichen aus, dass China von seiner Null-COVID-Strategie abrückt und einige konkrete Schritte zur Unterstützung des zusammengebrochenen Immobiliensektors unternimmt.

Der Fonds verzeichnete eine negative Gesamrendite im Berichtszeitraum und blieb aufgrund eines plötzlichen Anstiegs kurzfristiger US-Staatsanleiherenditen sowie dem kräftigen Anstieg von Schwellenländerspreads hinter dem Index zurück. Die Engagements in Russland und der Ukraine gehörten zu den größten Negativfaktoren für Spread-Renditen, da die Anleihekurse nach dem russischen Angriff auf die Ukraine kräftig fielen. Andersorts kam es durch Unternehmensanleihen am chinesischen Immobiliensektor sowie Staatsanleihen in Sri Lanka und Ghana zu Abzügen von der Wertentwicklung. Positiv wirkten sich dagegen vor allem die Beteiligungen in der Türkei, Brasilien und Kolumbien aus.

Nach dem starken Rückgang festverzinslicher EM-Wertpapiere im vergangenen Jahr sind die Aussichten für diese Anlageklasse im Jahr 2023 unserer Meinung nach positiver. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft zu einem eher zweiseitigen Risiko werden. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte. Auch bei EM-Hochzins-Unternehmensanleihen erwarten wir für 2023 einen Rückgang der Ausfallraten auf von 14,0 % auf 5,2 %, wobei die meisten Ausfälle chinesische Immobilienentwickler und ukrainische Emittenten betreffen werden. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen erwarten wir, dass die Ausfallquote bei hochverzinslichen EM-Unternehmensanleihen mit 3,3 % weitgehend dem historischen Durchschnitt entsprechen wird, da EM-Unternehmen im Durchschnitt über robuste Bilanzen verfügen.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde. In Anbetracht der aktuellen Renditeniveaus für EM-Hartwährungsanleihen vertreten wir die Ansicht, dass diese Risiken gut kompensiert werden. Wir halten die Bewertungen für EM-Anleihen mit einer kurzen Duration für attraktiv.



## Short Duration High Yield SDG Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -4,18 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.

In einem für die meisten festverzinslichen und aktienbasierten Anlageklassen turbulenten Jahr beendete der Markt für Hochzinsanleihen den Berichtszeitraum mit negativen Renditen. Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine, die erhöhte Inflation und hohen Rohstoffpreise, die Verschärfung der finanziellen Bedingungen und die Verlangsamung der Wirtschaftstätigkeit trugen zu der allgemein risikoscheuen Stimmung bei. Robuste Verbraucherausgaben und ein angespannter Arbeitsmarkt, die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine und andere Faktoren haben die Inflation in den USA auf ein 40-jähriges Hoch getrieben. Vor diesem Hintergrund begannen die US-Notenbank im März 2022 mit aggressiven Zinserhöhungen. Sie werden sich voraussichtlich fortsetzen, bis die Inflation unter Kontrolle ist. Die Credit-Spreads von Hochzinsanleihen weiteten sich aufgrund der risikoscheuen Periode und der rasch steigenden Zinsen. Die Renditen 10-jähriger US-Staatsanleihen und anderer richtungsweisender längerfristiger Staatsanleihen tendierten 2022 aufwärts, da das nominale BIP-Wachstum robust blieb und die Inflation in vielen Ländern den seit mehreren Jahren höchsten Stand erreicht hat. Diese Art von Umfeld behinderte nicht die Verbesserung bei Fundamentaldaten von Anleihen für die meisten Hochzinsemitenten, da sie die Preiserhöhungen weitergeben und sich an das neue Betriebsumfeld anpassen konnten. Die Differenzierung im Kreditbereich war auch im Jahr 2022 ein vorherrschender Faktor. Darüber hinaus sanken die Ausfallquoten in der ersten Hälfte des Jahres 2022 auf ein Allzeittief und stiegen dann in der zweiten Jahreshälfte nur geringfügig an. Darüber hinaus zogen höhere Renditen, bessere Bewertungen und die Besorgnis über steigende Zinssätze die Anleger in das Segment der Hochzinsanleihen mit kurzer Duration.

Im Berichtszeitraum erzielten Wertpapiere mit geringerer Qualität, wie die mit einem Rating von CCC und darunter im ICE BofA US High Yield Index, mit Renditen von -16,32 % eine Underperformance. Wertpapiere mit einem Rating von BB und B rentierten indessen mit -10,57 % bzw. -10,58 % für das Gesamtjahr. Im selben Zeitraum verzeichnete der ICE BofA US High Yield Non-Distressed Index -10,61 %, eine Underperformance gegenüber dem Gesamtindex, während der ICE BofA US High Yield Distressed Index ein Minus von -27,36 % verbuchte und damit deutlich hinter dem ICE BofA US High Yield Constrained Index (-11,21 %) zurückblieb. Der ICE BofA 0-5 Year BB-B US High Yield Constrained Index – ein Maßstab für qualitativ hochwertige hochverzinsliche Wertpapiere mit kürzerer Duration – verzeichnete im Jahr 2022 einen geringeren Rückgang von -4,97 %.

Im Dezember lag die paritätisgewichtete 12-monatige Ausfallrate für US-Hochzinsanleihen bei 0,84 % und blieb damit gegenüber dem Vormonat unverändert. Dies war der fünfte Monat in Folge ohne Ausfälle unter Hochzinsanleihen, was bisher einmalig ist. Obwohl die Ausfallrate von ihrem historischen Tiefstand zu Anfang 2022 (0,43 %) angestiegen ist, erwarten wir aufgrund unserer Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (50 % der Emittenten mit Kreditratings von BB) eine unterdurchschnittliche Zahl an Ausfällen, weniger aggressive Neuemissionen und weniger kurzfristige Fälligkeiten bei Hochzinsanleihen sowie mit einem Energiesektor im Anleihensegment ohne Investment Grade, der deutlich solider als in den letzten Zyklen ist. Zum Vergleich beträgt die langfristige durchschnittliche Ausfallquote 3,2 % (gestützt auf die jährlichen Ausfallquoten bis 1980 laut JP Morgan).

Im Laufe des Jahres trug die Positionierung in den Sektoren Stahl, Nahrungsmittel & Getränke sowie Luft- und Raumfahrt/Verteidigung am meisten zur Performance bei. Auf der gegenüberliegenden Seite des Spektrums lagen die Positionierungen in den Sektoren Medien und Kabel, Gesundheitswesen und diversifizierte Finanzdienstleistungen bei den Performanceabzügen vorne. Aus Sicht der Kreditratings war die Positionierung des Portfolios bei Papieren ohne Rating performanceneutral, die Positionierung in BBB und höher beeinträchtigte die Performance leicht und die Positionierung bei Emittenten mit den Ratings B, BB, CCC und niedriger beeinträchtigte die Wertentwicklung am meisten.

Die Spreads für Hochzinsanleihen weiteten sich 2022, doch wir denken, dass die Bewertungen die Anleger für die unterdurchschnittlichen Ausfallaussichten mehr als entschädigen. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hat zu einer Verlangsamung des realen BIP-Wachstums geführt, während die nachlassende Nachfrage dazu beigetragen hat, dass die Inflation etwas abkühlt. Sie liegt allerdings immer noch über den Zielvorgaben der Zentralbank. Die Normalisierung der Lieferketten und Veränderungen im Verbraucherverhalten dürften neben anderen Faktoren den Aufwärtsdruck auf die Inflation weiter mildern, was letztendlich zu einem weniger aggressiven Kurs der Zentralbankpolitik führen könnte. Unsere Analysten konzentrieren sich jedoch weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Die relative Gesundheit auf Verbraucherseite und ebenso gesunde Unternehmensbilanzen sowie ein wachsendes nominales BIP dürften die Fundamentaldaten der Emittenten weiterhin unterstützen. Während sich die Lagerbestände infolge der nachlassenden Nachfrage wieder füllen, konzentrieren wir uns weiterhin auf sektorspezifische Dynamiken und idiosynkratische Risiken für einzelne Emittenten. Trotz der kurzfristigen Volatilität, die sich aus der erhöhten Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum und die gestraffte Geldpolitik der Zentralbanken ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Kreditverschlechterungen und die Aufnahme in das Portfolio der ausnahmslos „besten Ideen“ – gut aufgestellt sind, um von der erhöhten Volatilität zu profitieren.

## Strategic Income – Bericht des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -10,24 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Minus von 13,01 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere gerieten im Berichtszeitraum unter Druck, da die hartnäckig hohe Inflation, die aggressive geldpolitische Straffung durch die Zentralbanken und die zunehmende Wahrscheinlichkeit einer deutlichen Wachstumsverlangsamung die Zinsen in die Höhe trieben und die Credit-Spreads ausweiteten. Letztere gingen im vierten Quartal teilweise zurück, da die Anlegernachfrage aufgrund attraktiverer Gesamterrenditen anzog. Insgesamt stieg die Rendite 10-jähriger US-Staatsanleihen im Berichtszeitraum um +236 Bp, während sich die Spreads von US-Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating<sup>1</sup> um +34 Basispunkte und von Krediten ohne Investment-Grade-Rating<sup>2</sup> um +172 Bp ausweiteten. Vor diesem Hintergrund erzielte der Fonds zwar eine negative Gesamterrendite, doch übertraf er den Index um +243 Bp.

Was die relative Performance betrifft, so trug die untergewichtete Duration des Portfolios im Berichtszeitraum am meisten zur Wertgenerierung bei. Die Untergewichtung von IG-Unternehmensanleihen und Agency-MBS war ebenfalls wertsteigernd. Diese positiven Effekte wurden teilweise durch die Allokation des Fonds zu IG-Unternehmensanleihen unterhalb von Investment Grade, Hypothekenkrediten, hybriden Finanztiteln und US-TIPS ausgeglichen.

Nach einem Jahr mit einer massiven weltweiten geldpolitischen Straffung gehen wir davon aus, dass sich die Inflation weiter von ihrem Höchststand entfernen wird. Allerdings wird sie auch im kommenden Jahr und bis ins Jahr 2024 deutlich über dem normalen Niveau und den Zielvorgaben der Zentralbanken bleiben. In den Sitzungen der Zentralbanken und in den Äußerungen der Entscheidungsträger kam zum Ausdruck, dass sie zur Dämpfung des Preisdrucks eine straffe Geldpolitik beibehalten müssen. Obwohl es also noch zu einigen weiteren Zinserhöhungen kommen könnte, werden die US-Zinsen am kurzen Ende unseres Erachtens noch einige Zeit hoch bleiben. Mit anderen Worten: Die Welt der Nullzinsen, so dominierend nach der globalen Finanzkrise, ist wahrscheinlich vorbei.

Wir sind der Meinung, dass die US-Notenbank einen Großteil ihrer schweren Arbeit abgeschlossen hat und erwarten, dass die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere im Jahr 2023 ruhiger sein werden. Unserer Ansicht nach könnte dies eine große Chance bieten, höhere Renditen bei begrenztem Risiko zu erzielen. Dies umso mehr angesichts des zusätzlichen Renditepolsters, das durch die letztjährige Neubewertung geschaffen wurde. Unsere größte Begeisterung ist in diesem Zusammenhang dem IG-Markt zugeordnet.

Wir gehen davon aus, dass sich die Zinssätze in einer viel engeren Spanne bewegen werden als im Jahr 2022, da die Inflation nachlässt und die Zentralbanken ihre Zinsen schrittweise anheben. Wir glauben, dass das Durationsengagement weniger riskant sein dürfte als 2022. Die grundsätzlichen Bedenken hinsichtlich Unternehmensanleihen dürften jedoch zunehmen, und zwar nicht nur aufgrund der makroökonomischen Entwicklungen, sondern auch in Abhängigkeit von der Dynamik und der Finanzlage der einzelnen Emittenten. Die Einzeltitelauswahl ist in der Folge wichtiger denn je.

Trotz des Potenzials für eine wirtschaftliche Verschlechterung in diesem Jahr ist das Ausfallszenario unserer Ansicht nach relativ günstig. Der Verschuldungsgrad der Unternehmen ist allgemein niedriger und die Liquiditätsbestände sind höher als vor der Pandemie. Die Muster bei den Neuemissionen waren weniger aggressiv, sowohl was die Verwendung der Erlöse als auch die Ratingkategorien betrifft. Darüber hinaus konnten viele Unternehmen aufgrund der extrem niedrigen Renditen der letzten Jahre ihre Laufzeiten zu niedrigen Zinssätzen verlängern, wodurch in den Jahren 2023 und 2024 nur noch relativ wenige Anleihen fällig werden. Dessen ungeachtet besteht der allgemeine Konsens, dass es 2023/2024 zu einem Anstieg der Ausfälle bei Hochzinsanleihen kommen wird, insbesondere wenn die Rezession unerwartet schlimm ausfällt.

Was bedeutet das für die Portfoliopositionierung an den Märkten für Unternehmensanleihen? Die Differenzierung im Kreditbereich wird zunehmen, sobald sich die Auswirkungen höherer Zinsen und einer langsameren Konjunktur in den tatsächlichen Unternehmensgewinnen und -ergebnissen niederschlagen werden. Wir denken, dass sich die Märkte für Unternehmensanleihen im Jahr 2022 eher von „Makro-Ergebnissen“ geprägt zu einem stärker von fundamentalen Ergebnissen geprägten Szenario entwickeln werden. Ein wichtiger Unsicherheitsfaktor ist die Frage, ob die gemischte wirtschaftliche Entwicklung zu mehr Inflation als erwartet führen könnte und damit zu mehr Schwierigkeiten an den Finanzmärkten. Dies ist nicht unser Basiszenario, es muss aber in Betracht gezogen werden, da wir uns immer noch auf unsicherem Terrain bewegen.

<sup>1</sup> Investment Grade: Bloomberg US Credit Index

<sup>2</sup> Ohne Investment Grade: ICE BofA US High Yield Constrained Index

## Sustainable Asia High Yield – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -15,76 %. Im selben Zeitraum verbuchte der JP Morgan ESG Asia Credit (JESG JACI) – High Yield Index (Total Return, USD) (der „Index“) ein Minus von 14,65 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Asiatische Hochzinsanleihen verbuchten im Berichtszeitraum deutliche Rückgänge, die vorrangig auf die Entwicklung des chinesischen Immobiliensektors zurückzuführen waren. Unter dem Mantra des „gemeinsamen Wohlstands“ setzten die chinesischen Behörden ihre Politik des erzwungenen Schuldenabbaus im Immobiliensektor fort. Daraus resultierten ein hohes Maß an Kreditstress und eine große Zahl von Ausfällen auf dem Markt. Außerhalb des chinesischen Immobiliensektors schnitten die Märkte für asiatische Hochzinsanleihen vergleichsweise besser ab. Dennoch verzeichneten sie überwiegend negative Renditen für das Kalenderjahr. Es war angesichts der steigenden Kernrenditen und der sich verschärfenden finanziellen Bedingungen ein schwieriges Jahr für die Anlageklasse.

Gegen Ende des Berichtszeitraums zeigten die Märkte Anzeichen einer Erholung, die auf zwei wichtige Entwicklungen in China zurückzuführen waren: erstens die wachstumsfördernde Haltung der Regierung, einschließlich der Wiedereröffnung der Wirtschaft und der Abkehr von der Null-COVID-Politik, und zweitens die Hinwendung zu einer für den Immobiliensektor mehr unterstützenden Politik. Die chinesischen Behörden haben die strengen Reise- und Aktivitätsbeschränkungen im Zuge besagter Wiedereröffnung aufgehoben, was der positiven Stimmung im chinesischen Kreditkomplex entgegenkam. Was den Immobiliensektor betrifft, so haben sich die chinesischen Aufsichtsbehörden positiver zur Finanzierung von Bauträgern geäußert, und die People's Bank of China („PBoC“) und die China Banking and Insurance Commission („CBIRC“) betonten die Notwendigkeit, die Risiken für „qualitativ hochwertige und systematisch wichtige“ Bauträger zu mindern. Angesichts der beispiellosen Volatilität an den asiatischen Märkten für Unternehmensanleihen im Laufe des Jahres waren die Auswahl dieser Titel und das Risikomanagement entscheidend. Insgesamt trug die Titelauswahl positiv zur relativen Rendite gegenüber dem Index bei. Ein wichtiger Grund dafür war die Vermeidung vieler notleidender und ausgefallener Unternehmensanleihen in China. Auch die Übergewichtung des Portfolios in Indien, einschließlich des Engagements bei Emittenten im Bereich der erneuerbaren Energien, sowie die Titelauswahl in Indonesien trugen positiv zur Wertentwicklung bei. Andererseits schmälerten die untergewichteten Positionen des Portfolios auf den Philippinen und in Singapur, die sich durch ein eher niedriges Beta auszeichnen, zusammen mit der Untergewichtung in Macau die relative Rendite.

Nach dem seit Jahrzehnten schlechtesten Jahr für asiatische Unternehmensanleihen und die Schwellenländer („EM“) im Allgemeinen sind wir der Meinung, dass die Aussichten für die Anlageklasse im Jahr 2023 viel besser sind. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in den großen asiatischen Volkswirtschaften ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, glauben wir, dass der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft möglicherweise zu einem eher zweiseitigen Risiko werden könnte. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch könnte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die Region führen. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für asiatische Hochzinsanleihen im Jahr 2023 aufgrund der positiven Entwicklungen in China sinken werden. Speziell in Bezug auf China sind wir der Ansicht, dass angesichts des Entgegenkommens der Politik gegenüber Bauträgern sowie der allgemeinen wachstumsfördernden Haltung der Regierung eine positivere Haltung nun gerechtfertigt ist. Darüber hinaus sind wir der Ansicht, dass der breitere China-Komplex, einschließlich Macau, in Zukunft von der Wiedereröffnung profitieren könnte. Außerhalb Chinas bleiben wir angesichts der attraktiven Fundamentaldaten und der Bewertungen gegenüber Kreditgelegenheiten positiv, insbesondere in Südostasien. In Bezug auf Hochzinsanleihen von indischen Unternehmen bleiben wir optimistisch, da makroökonomische Fundamentaldaten weiter Unterstützung bieten und Emittenten aus dem Land einen starken Fokus auf Praktiken im Bereich Umwelt, Soziales und Governance („ESG“) haben.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir zum einen in entweder einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben könnte, oder zum anderen in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die mehr Zinserhöhungen erforderlich machen könnte. In Anbetracht der aktuellen Renditeniveaus für asiatische Hartwährungsanleihen vertreten wir die Ansicht, dass diese Risiken gut kompensiert werden. Wir halten die Bewertungen asiatischer Kredite für attraktiv.

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Berichts des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -12,06 %. Im gleichen Zeitraum erzielte der JPMorgan ESG (JESG) CEMBI Broad Diversified Index (der „Index“) eine Rendite von -10,63. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Das Portfolio wurde am 3. Oktober 2022 auf eine nachhaltige Strategie umgestellt. Im Rahmen der Umstellung strebt der Fonds nun eine Reduzierung der Kohlenstoffintensität um mehr als 30 % und einen höheren ESG-Score 1 im Vergleich zum EM Corporate Debt-Universum an. Am 3. Oktober 2022 wird aufgrund des Strategiewechsels der JPMorgan ESG (JESG) CEMBI Broad Diversified Index als Performancebenchmark herangezogen. Im Zeitraum vom 3. Oktober 2022 bis zum 31. Dezember 2022 erzielte die thesaurierende Klasse USD I eine Rendite von 5,60 % und übertraf damit den Index, der auf ein Plus von 5,17 % kam. Für den gesamten Berichtszeitraum erzielte die thesaurierende Klasse USD I eine Rendite von -12,06 % und übertraf damit den vorherigen Index, den JPMorgan CEMBI Diversified Index, der im Berichtszeitraum eine Rendite von -12,92 % verbuchte.

Dies war eine äußerst turbulente Zeit für Schwellenländer („EM“), die mit den anhaltenden Risiken durch COVID-19 – insbesondere China, wo die Behörden den größten Teil des Jahres an einer rigiden Politik festhielten – sowie dem Zusammenbruch des Immobiliensektors (Ausfälle erreichten 2022 50 %) und Russlands Einmarsch in der Ukraine, mit einer hartnäckig hohen Inflation, die zur aggressivsten Straffung der Geldpolitik seit Jahrzehnten führte, und mit einem stärkeren Dollar konfrontiert waren. So kam es zu einem starken Anstieg der Leitzinsen und dem schlechtesten Performancejahr für den Index seit der globalen Finanzkrise. Dieser Druck auf die Märkte ging gegen Ende des Jahres zurück, da der nachlassende Preisdruck in den USA und der Eurozone das Thema der Rekordinflation unterstützte. Hilfreich wirkten sich zudem die Anzeichen aus, dass China von seiner Null-COVID-Strategie abrückte und einige konkrete Schritte zur Unterstützung des Immobiliensektors unternimmt. Die Ausfallquote bei Hochzins-Unternehmensanleihen erreichte 14,0 %, da Unternehmen in Russland, der Ukraine und dem chinesischen Immobiliensektor im Laufe des Jahres mit erheblichem Gegenwind zu kämpfen hatten.

Der JPMorgan CEMBI Diversified Index verbuchte für das Jahr negative Renditen. Die Spreads begannen das Jahr mit 255 Bp, erreichten im Oktober einen Höchststand von 425 Bp und beendeten das Jahr mit 308 Bp. Die Renditen stiegen von 4,49 % zu Beginn des Jahres auf 7,27 % zum Jahresende und erreichten im Oktober mit 8,57 % ihren Höchststand. Das Hochzinssegment des Markts schnitt im Geschäftsjahr besser ab als Investment-Grade-Titel. Alle Regionen verzeichneten eine negative Performance, wobei Lateinamerika im Jahresverlauf die geringste negative Wertentwicklung verzeichnete. Die Länder mit der besten Performance im Index waren Argentinien und die Türkei. Sie verbuchten positive Renditen, während die übrigen Länder eine negative Wertentwicklung verzeichneten. Nach Sektoren schnitten Rohstoffe mit einem Minus von über 20 % im Jahresverlauf am schlechtesten ab. Defensive Sektoren wie Finanzwerte, diversifizierte Unternehmen, Infrastruktur und Versorger gaben im Jahr 2022 nur einstellig nach.

Über das Jahr gesehen schnitt der Fonds besser ab als die Benchmark. Die Positionierung in Russland war der Haupttreiber für die Outperformance, insbesondere die fehlenden Positionen in der VTB Bank oder der Sberbank, deren Kurse einher mit allen russischen Unternehmensanleihen unabhängig vom Sektor nach dem Einmarsch in die Ukraine und den in Bezug auf das Land erhobenen Sanktionen deutlich fielen. Die Wertpapierauswahl in China beeinträchtigte jedoch aufgrund des Engagements im Immobiliensektor, der erheblichem Druck ausgesetzt war, was zu aktuellen Ausfällen führte. Eine Position in einem chilenischen Telekomunternehmen war aufgrund der schwächeren operativen Performance und der angespannten Liquiditätssituation ebenfalls nachteilig für die Wertentwicklung. Im Rahmen der Länderallokation war das übergewichtete Engagement in Brasilien positiv, da das Land seine Wahl ohne größere Unruhen über die Bühne brachte. Negativ waren die Übergewichtung der Ukraine und die Untergewichtung der Türkei und asiatischer Länder mit Investment-Grade-Rating.

Wir glauben, dass die Aussichten für die Anlageklasse im Jahr 2023 besser aussehen. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in den vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, sollte der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft zu einem eher zweiseitigen Risiko werden könnte. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-19-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen. Bei EM-Hochzins-Unternehmensanleihen („HY“) erwarten wir für 2023 einen Rückgang der Ausfallraten auf von 14,0 % auf 5,2 %, wobei die meisten Ausfälle chinesische Immobilienentwickler und ukrainische Emittenten betreffen werden. In Anbetracht der jüngsten Maßnahmen der chinesischen Regierung denken wir, dass die Erwartungen in Bezug auf Zahlungsausfälle in Zukunft weiter sinken werden. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen erwarten wir, dass die Ausfallquote bei EM-HY mit 3,3 % weitgehend dem historischen Durchschnitt entsprechen wird, da EM-Unternehmen im Durchschnitt über robuste Bilanzen verfügen.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde. In Anbetracht der aktuellen Renditeniveaus für EM-Hartwährungsanleihen vertreten wir die Ansicht, dass diese Risiken gut kompensiert werden. Wir halten die Bewertungen für EM-Unternehmensanleihen für attraktiv.

<sup>1</sup> Die Strategie zielt auf einen im Vergleich zum breiteren Markt höheren MSCI ESG-Score, repräsentiert durch den JPMorgan CEMBI Diversified Index, während Emittenten mit sehr schwachen ESG-Praktiken ausgeschlossen werden.

<sup>2</sup> Der JPMorgan CEMBI Diversified Index

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Berichts des Investment-Managers

Seit der Auflegung am 19. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -14,60 %. Der als Benchmark dienende JPM ESG EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Minus von 16,06 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Dies war eine äußerst turbulente Zeit für Schwellenländer („EM“), die mit den anhaltenden Risiken durch die COVID-19-Pandemie – insbesondere China, wo die Behörden den größten Teil des Jahres an einer rigiden Politik festhielten – mit Russlands Einmarsch in der Ukraine, mit einer hartnäckig hohen Inflation, die zur aggressivsten Straffung der Geldpolitik seit Jahrzehnten führte, und mit einem stärkeren Dollar konfrontiert waren. Infolgedessen kam es zu einem starken Anstieg der Kernzinsen und den zweit schlechtesten jährlichen Renditen des Index seit seiner Einführung im Jahr 1994. Dieser Druck auf die Märkte ging gegen Ende des Jahres zurück, da der nachlassende Preisdruck in den USA und der Eurozone das Thema der Rekordinflation unterstützte. Anzeichen dafür, dass China von seiner Null-COVID-Politik abrückt, waren ebenfalls unterstützend. Die Indexausfallquote des breiten Marktes erreichte 7,3 %, da Weißrussland, Russland, Sri Lanka und die Ukraine ihre Auslandsverbindlichkeiten nicht mehr bedienen konnten, während Ghana ebenfalls seine Absicht kundtat, dem zu folgen. Die Unterstützung durch den IWF blieb ein wichtiges Thema für mehrere Schwellenländer wie Argentinien, Ägypten und Pakistan sowie ein Anker für die laufenden Umstrukturierungsprozesse in Ghana, Sri Lanka und Sambia. Die Index-Spreads weiteten sich von 317 Basispunkten auf 377 Basispunkte und erreichten gegen Mitte Juli einen Höchststand von 509, während die Renditen auf US-Staatsanleihen das Jahr bei 3,87 % gegenüber 1,51 % zu Jahresbeginn beendeten. Die Indexrendite bis zur Fälligkeit lag Ende 2022 bei 7,8 %, gegenüber 4,81 % Ende 2021.

Die beste Performance im allgemeinen Marktindex verbuchte der Irak (aus dem Index ausgeschlossen), unterstützt durch die hohen Ölpreise, und Costa Rica ab, wo die fiskalischen und externen Risiken durch die kontinuierliche Einhaltung des IWF-Programms gemildert wurden. Am schlechtesten schnitt die Ukraine angesichts der schrecklichen wirtschaftlichen Verwüstung durch die russische Aggression ab, gefolgt von Pakistan (ebenfalls aus dem Index ausgeschlossen), dessen Finanzierungsprobleme durch erhebliche Überschwemmungen noch verstärkt wurden.

Das Portfolio übertraf den Index, was hauptsächlich auf die Länderallokation zurückzuführen war. Die Einzeltitelauswahl und die Top-down-Positionierung waren hingegen negativ. Bei der Länderallokation trugen unser ESG-bedingter Verzicht auf Russland und Weißrussland sowie unsere übergewichtete Allokation zu Costa Rica und Oman, wo Reformen in den Bereichen Steuern und Unternehmensführung das Land gegenüber dem Marktabschwung widerstandsfähiger machten, zur Performance bei. Unsere Nullgewichtung von Saudi-Arabien und Katar aufgrund von ESG-Kriterien und unsere übergewichtete Allokation zur Ukraine wirkten sich am stärksten negativ aus. Unsere Unternehmenspositionierung in China, wo Staatsanleihen und quasistaatliche Anleihen aufgrund von ESG-Kriterien ausgeschlossen sind, war für die meisten Abzüge durch die Titelauswahl verantwortlich. Insgesamt war die Unternehmenspositionierung jedoch positiv.

Wir glauben, dass die Aussichten für die Anlageklasse im Jahr 2023 deutlich besser aussehen. Mit der erheblichen Straffung der Geldpolitik hinter uns und einer Inflation, die sowohl in den USA als auch in vielen Schwellenländern ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte, glauben wir, dass der durch steigende Zinssätze bedingte Druck nachlassen und in Zukunft zu einem eher zweiseitigen Risiko werden könnte. In China wird die plötzliche Lockerung der COVID-Beschränkungen die Wirtschaftstätigkeit zwar kurzfristig beeinträchtigen, doch sollte die Wiedereröffnung der Wirtschaft und die erneute Konzentration der Politik auf die Unterstützung des Wachstums später im Jahr zu einer kräftigen wirtschaftlichen Erholung mit positiven Auswirkungen auf die globalen Schwellenländer führen. Wir erwarten, dass die Ausfallraten für Staatsanleihen bis 2023 auf einen niedrigen einstelligen Prozentsatz sinken werden, während das zunehmende Engagement des IWF in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenden unterstützen dürfte.

Die Hauptrisiken für unsere positive Einschätzung sehen wir entweder in einer möglichen globalen Rezession, die die Spreads der Schwellenländer erheblich in die Höhe treiben würde, oder in einer unerwarteten Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erforderlich machen würde.

Unserer Meinung nach werden die technischen Daten günstig sein, da die Mittelzuflüsse in die Anlageklasse nach den beträchtlichen Abflüssen im vergangenen Jahr wieder anlaufen und die Nettoemissionen negativ bleiben, insbesondere in den Märkten für höher verzinsliche Wertpapiere. Wir sind der Ansicht, dass die Spread-Ausweitung bei Hartwährungsanleihen aus Schwellenländern in diesem Jahr unverhältnismäßig hoch war, vorrangig bei Hochzinsanleihen, und wir halten die Bewertungen derzeit auf absoluter Basis für attraktiv.

## Systematic Global Sustainable Value – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -12,92 %. Im gleichen Zeitraum erzielten der MSCI ACWI (All-Country World Index) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „übergeordnete Index“) und der MSCI All-Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Sekundärindex“) eine Rendite von -7,55 % bzw. -18,36 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Die globalen Aktienmärkte waren während des gesamten Jahres 2022 durch eine anhaltende Volatilität geprägt, wobei kurze Erholungsphasen die insgesamt negativen Gesamterträge der Performance während des Berichtszeitraums nicht wettmachen konnten. Die Inflation stand bei den Anlegern ganz oben auf der Agenda, da der Verbraucherpreisindex („VPI“) auf die seit Jahrzehnten höchsten Marken kletterte, bevor er seinen Höchststand erreichte und anschließend bis zum Jahresende wieder leicht zurückging. Die US-Notenbank (die „Fed“) setzte ihre aggressiven Zinserhöhungen auch im Jahr 2022 fort und geht davon aus, dass sie die Zinsen selbst im Falle einer Konjunkturabschwächung „für länger hoch“ halten wird. Der Einkaufsmanagerindex („PMI“) begann das Jahr stark, verzeichnete aber eine leichte Abschwächung in den USA und Europa, als die verzögerten Nachwirkungen der Zinserhöhungen Wirkung zeigten. Vor dem Hintergrund negativer Konsensprognosen, was historisch gesehen auf eine bevorstehende Rezession hindeutet, hat sich die Renditekurve der US-Staatsanleihen in der zweiten Jahreshälfte 2022 umgekehrt. Die chinesische Regierung begann damit, die seit fast drei Jahren geltende restriktive Null-COVID-Politik zu lockern, da die Regierung plante, im neuen Jahr die Grenzen zu öffnen und die Quarantäneregulungen für Reisende zu lockern.

Während des Berichtszeitraums sorgte die Value-Ausrichtung des Portfolios angesichts der anhaltenden Marktvolatilität während diesem Jahr für gemischte relative Renditen, wobei sie hinter dem übergeordneten Index zurückblieb und den Sekundärindex übertraf. Unsere Underperformance gegenüber dem übergeordneten Index lag in erster Linie an der Wertpapierauswahl in den USA und in Europa (ohne das Vereinigte Königreich), während Japan einen positiven Wertbeitrag leistete. Die Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Industriewerte waren für die Underperformance des Portfolios ausschlaggebend, während die Titelauswahl im Gesundheitswesen und im Sektor Energie im Vergleich zum übergeordneten Index positiv war. Aus Faktorsicht war die Underperformance gegenüber dem übergeordneten Index den Aktienfaktoren Wert, Liquidität und Momentum zuzuschreiben, während die Volatilität zunahm.

Die Outperformance des Portfolios gegenüber dem Sekundärindex lag in erster Linie an der Wertpapierauswahl in den USA und Japan, während sie im Vereinigten Königreich für Abzüge sorgte. Die Sektoren Gesundheitswesen und Kommunikationsdienste waren maßgeblich für die Outperformance des Portfolios, die Wertpapierauswahl unter Versorgern blieb indessen hinter dem Sekundärindex zurück. Aus Faktorsicht war die Outperformance gegenüber dem Sekundärindex den Faktoren Wert, Volatilität und Qualitätsaktien zuzuschreiben, der Faktor Liquiditätsfaktor erwies sich hingegen als abträglich.

Unser Ausblick auf das Jahr 2023 stützt sich auf die aktuellen Wachstums- und Inflationstrends sowie auf die jüngsten Kommentare der US-Notenbank. Wir denken, dass sich das globale Wirtschaftswachstum weiter verlangsamen wird und die Inflation bis Mitte 2023 weiter sinken könnte. Des Weiteren gehen wir davon aus, dass die USA wahrscheinlich in eine Rezession eintreten werden, wobei eine moderate Rezession wahrscheinlich ist und ein schwerwiegenderer Abschwung möglicherweise vermieden werden kann.

## Ultra Short Term Euro Bond – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I auf -5,59 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) verzeichnete im selben Zeitraum ein Minus von -0,94 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Während des Berichtszeitraums war der Markt durch einen abrupten Abverkauf bei den Zinsen gekennzeichnet. Die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen stieg deutlich von -0,20 % auf +2,56 %, ihr höchster Stand seit 2011. Auslöser für den Abverkauf der Zinsen war der schnellste Preisanstieg seit den 1970er Jahren, der vor allem auf die höheren Rohstoffpreise infolge der russischen Invasion in der Ukraine zurückzuführen war. Darüber hinaus übten Engpässe in der Lieferkette aufgrund der chinesischen Lockdowns zusätzlichen Druck auf die rasante Inflation aus. Während des Berichtszeitraums kam es nicht nur zu einer Ausweitung der Zinssätze, sondern auch zu einer Inversion der europäischen Zinskurve, wobei sich die 2-jährigen deutschen Zinssätze stärker ausweiteten als die 10-jährigen. Erstere beendeten das Jahr mit 336 Bp und letztere mit nur 276 Bp. Da das Portfolio hauptsächlich am kurzen Ende der Kurve investiert war, wurde es trotz einer strukturellen Short-Position im deutschen Schatzanleihen stark von dieser Kurveninversion getroffen.

Die Europäische Zentralbank („EZB“) reagierte auf die hohe und sich beschleunigende Inflation mit einer Straffung der Geldpolitik mittels Zinserhöhungen sowie durch eine quantitative Straffung, was zu einer Verlangsamung des Wirtschaftswachstums führte. Die Marktteilnehmer verzeichneten Abflüsse aus festverzinslichen Fonds und verkauften verstärkt Risiko, was zu einer weiteren Ausweitung der Zinsen und Spreads führte. Die Credit-Spreads europäischer Investment-Grade-Anleihen („IG“) weiteten sich im Berichtszeitraum von 96 Bp auf 168 Bp aus, was einen negativen Effekt auf das Portfolio hatte. In der Zwischenzeit weiteten sich die Credit-Spreads europäischer Hochzinsanleihen („HY“) von 316 Bp auf 512 Bp. Die aktive Absicherung durch eine Short-Position im ITraxx Crossover hielt die Verluste in Grenzen.

Zu den Sektoren verantwortlich für Wertabzüge gehörten die zyklischsten wie Auto, Einzelhandel und Fluggesellschaften. Außerdem schnitten Finanzwerte schlechter ab als Industriewerte. Wir nutzten den Ausverkauf an den Märkten für Unternehmensanleihen, um die am stärksten betroffenen Sektoren, z. B. Finanzwerte, aufzustocken. Ein weiteres Thema war im Jahr 2022 die Dekompression der IG- und HY-Spreads, ein Grund dafür, dass wir das taktische Segment des Portfolios auf die Obergrenze von 20 % reduzierten. Dies erlaubte es dem Portfolio, sein Engagement in Hochzinsanleihen, nachrangigen Finanztiteln und kündbaren hybriden Unternehmensanleihen zu erhöhen. Wir konnten das Kreditrisiko bedenkenlos erhöhen, da die Fundamentaldaten nach wie vor sehr solide und die Gesamrenditen sehr attraktiv sind.

Variabel verzinsliche Wertpapiere, forderungsbesicherte Wertpapiere („ABS“) und inflationsindexierte Anleihen lieferten 2022 eine Outperformance, da sie von der fehlenden Duration bzw. von einem an die steigende Inflation gekoppelten Kupon profitierten. Gegen Ende des Jahres haben wir sowohl ABS als auch inflationsindexierte Anleihen reduziert, um das Durationsrisiko des Portfolios nach oben zu fahren, da wir zu glauben begannen, dass wir uns in Europa den Endsätzen und einem Inflationshöhepunkt nähern. Um die Konvexität zu erhöhen, fügten wir dem Portfolio IG-Unternehmensanleihen mit festem Kupon hinzu.

Für das neue Jahr gehen wir davon aus, dass sich die Euro-Zinsen und die Credit-Spreads nach der erheblichen Ausweitung im Jahr 2022 stabilisieren werden. Da wir glauben, dass die Inflation ihren Höhepunkt erreicht hat oder kurz vor ihrem Höhepunkt steht, dürfte die Zukunft für europäische Anleihen rosiger sein als noch im letzten Jahr. Das derzeitige Niveau der Renditen auf europäische Anleihen ist so hoch wie schon seit Jahren nicht mehr, da die Preise die erheblichen Erhöhungen durch die Zentralbanken widerspiegeln und nicht ignoriert werden können.

## Uncorrelated Strategies – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf 8,33 %. Die Benchmark des Portfolios, der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 1,21 %. Bei dem Index handelt es sich um einen Cash Index. Die Wertentwicklung des Portfolios ist nicht darauf ausgelegt, die Wertentwicklung des Index abzubilden oder zu replizieren. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Das Portfolio erzielte in den ersten drei Quartalen des Berichtszeitraums eine starke Wertentwicklung, bevor die Rendite im letzten Quartal des Berichtszeitraums vor größere Herausforderung gestellt war. Auf eine starke Rendite des Portfolios von 2,99 % im ersten Quartal folgte eine anhaltend starke Performance im zweiten Quartal mit einer Rendite von 5,45 %, gefolgt von 3,25 % im dritten Quartal und einer negativen Performance von -3,39 % im vierten Quartal.

Das Portfolio hatte in diesem Zeitraum bei sieben Strategien Allokationen. Vier der Strategien trugen positiv zur Rendite bei (in der Reihenfolge ihrer Beiträge): Short Term Trading, Trend Following, Global Macro und Volatility Relative Value. Die Strategien, die im Laufe des Jahres negativ abschnitten, waren Equity Market Neutral, Statistical Arbitrage und Insurance-Linked Securities.

Das Portfolio handelte während des gesamten Geschäftsjahres mit Währungen, Aktien, festverzinslichen Staatsanleihen/Zinsen und Kreditpapieren. Nach Anlageklasse gab es positive Beiträge zur Portfolioperformance von festverzinslichen Staatsanleihen/Zinsen und Währungen. Der Handel mit Aktien und Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung im Jahresverlauf.

Im Laufe des Jahres hat das Portfolio keine Unterberater aufgenommen und sich von keinen getrennt. Am Ende des Berichtszeitraums war das Portfolio zehn externen Unterberatern für sechs Strategien zugeteilt, mit einer zusätzlichen internen Unterberatung für Insurance-Linked Securities.

Das Portfoliorisiko ist gemäß einer Reihe an wichtigen Überlegungen nach wie vor stark diversifiziert, u. a. nach Strategietypen, dem Gleichgewicht zwischen langfristigen und systematischen Ansätzen, den Arten der verwendeten Dateninputs, dem Zeithorizont der Positionierung und den zugrunde liegenden Anlageklassen und gehandelten Kontrakten. Wichtig ist, dass das Portfolio weiterhin insbesondere auf ein Renditeprofil abzielt, das weder mit den traditionellen Aktien- noch den Anleihemärkten korreliert ist und während ungünstiger Zeiten für die breiten Märkte Schutz bietet.

Vorausschauend können wir die mittelfristigen fundamentalen makroökonomischen Aussichten nicht mit Sicherheit vorhersagen, doch können wir einige Beobachtungen zum Umfeld und zu den Portfoliostrategien machen. Das vierte Quartal 2022 war für die Aktienausswahl zweifelsohne schwierig, da die Hedgefonds-Gemeinschaft einen erheblichen Schuldenabbau durchführte. Bei den Gewinn- und Verlustrechnungen haben sich nun etwas die Wogen geglättet und das Bruttoengagement der Hedgefonds ist niedriger, wobei die Faktorengagements ausgewogener sind. Das bedeutet, dass wir uns zu Beginn des ersten Quartals 2023 an einem Punkt befinden könnten, an dem es aus technischer Sicht wohl weniger Hürden zu meistern gilt, mehr Barmittel zur Verfügung stehen und potenziell die Chance besteht, von einigen der im vierten Quartal 2022 aufgetretenen Marktverwerfungen zu profitieren. Equity Market Neutral war 2022 eine enttäuschende Strategie, aber es kommt immer mal wieder vor, dass ein Underperformer in einem Kalenderjahr im darauffolgenden Jahr zu den Spitzenreitern gehört. Das Volatilitätsumfeld ist bei Zinsen und Währungen sowie in Bezug auf Einzeltitel weiterhin hoch, während die Volatilität der Aktienindizes immer noch gedämpft ist. Da die Anleger weiterhin mit Umschichtungen in ihren Vermögenswerten auf die Veröffentlichung wichtiger Wirtschaftsdaten reagieren, dürfte dies der Volatilität im Allgemeinen förderlich sein und konvexe Ansätze begünstigen, wie wir sie in unser Portfolio aufnehmen wollen. Wir glauben, dass solche Strategien auch einen wertvollen Schutz für den Fall bieten können, dass unerwartete Risiken auftreten. In einem Umfeld mit so bedeutenden strukturellen Veränderungen und der damit verbundenen Unsicherheit, in dem wir uns heute befinden, ist dies besonders wichtig. Das Gleiche gilt ebenfalls für dynamische Strategien wie Short Term Trading. Bei Währungen, Zinssätzen und Anleihen sehen wir zweifelsohne immer noch Bewegungen in einer großen Bandbreite. Da wir uns aber weiterhin auf unsere Strategien konzentrieren, glauben wir, dass weitere Ausbrüche aus diesen Bandbreiten und kurzfristige Momentumschwankungen das Potenzial haben, die Rendite zu steigern.



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX – Berichts des Investment-Managers

Für den Berichtszeitraum von seiner Auflegung am 22. Juni 2022 bis zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD X 0,00 %. Die Benchmark des Portfolios, der ICE BofA 1-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 1,43 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Das Portfolio hatte in diesem Zeitraum bei vier Strategien Allokationen. Zwei der Strategien trugen positiv zur Rendite bei, wobei der Hauptmotor der Rendite die Short-Term-Trading-Allokation war. Kleinere zusätzliche Wertbeiträge kamen der Allokation zu Volatility Relative Value. Die Hauptantriebskraft der negativen Performance nach Strategie war die Allokation zu Equity Market Neutral. Die Statistical-Arbitrage-Allokation war für einige geringe Abzüge verantwortlich.

Das Portfolio handelte während des gesamten Berichtszeitraums mit Währungen, Aktien, festverzinslichen Staatsanleihen/Zinsen und Kreditpapieren. Nach Anlageklasse gab es positive Beiträge zur Portfolioperformance von festverzinslichen Staatsanleihen/Zinsen und Kreditpapieren. Der Handel mit Aktien und Währungen schmälerte die Performance im Berichtszeitraum.

Im Anschluss an die Auflegung des Portfolios wurden im Berichtszeitraum keine neuen Unterberater aufgenommen und sich auch von keinen getrennt. Zum Jahresende war das Portfolio über vier Strategieallokationen sechs externen Unterberatern in zugeteilt.

Das Portfoliorisiko war gemäß einer Reihe an wichtigen Überlegungen nach wie vor stark diversifiziert, u. a. nach Strategietypen, dem Gleichgewicht zwischen langfristigen und systematischen Ansätzen, den Arten der verwendeten Dateninputs, dem Zeithorizont der Positionierung und den zugrunde liegenden Anlageklassen und gehandelten Kontrakten. Wichtig ist, dass das Portfolio weiterhin insbesondere auf ein Renditeprofil abzielte, das weder mit den traditionellen Aktien- noch den Anleihenmärkten korreliert war und während ungünstiger Zeiten für die breiten Märkte Schutz bietet.

Vorausschauend können wir die mittelfristigen fundamentalen makroökonomischen Aussichten nicht mit Sicherheit vorhersagen, doch lassen sich einige Beobachtungen zum Umfeld und zu den Portfoliostrategien machen. Das vierte Quartal 2022 war für die Aktienausswahl zweifelsohne schwierig, da die Hedgefonds-Gemeinschaft einen erheblichen Schuldenabbau durchführte. Bei den Gewinn- und Verlustrechnungen haben sich nun etwas die Wogen geglättet und das Bruttoengagement der Hedgefonds ist niedriger, wobei die Faktorengagements ausgewogener sind. Das bedeutet, dass wir uns zu Beginn des ersten Quartals 2023 an einem Punkt befinden könnten, an dem es aus technischer Sicht wohl weniger Hürden zu meistern gilt, mehr Barmittel zur Verfügung stehen und potenziell die Chance besteht, von einigen der im vierten Quartal 2022 aufgetretenen Marktverwerfungen zu profitieren. Equity Market Neutral war 2022 unsere Strategie mit der schlechtesten Performance und wir sind fraglos enttäuscht. Es kommt aber immer mal wieder vor, dass der schlechteste Performer in einem Kalenderjahr im darauffolgenden Jahr zu den Spitzenreitern gehört. Das Volatilitätsumfeld ist bei Zinsen und Währungen sowie in Bezug auf Einzeltitel weiterhin hoch, während die Volatilität der Aktienindizes immer noch gedämpft ist. Da die Anleger weiterhin mit Umschichtungen in ihren Vermögenswerten auf die Veröffentlichung wichtiger Wirtschaftsdaten reagieren, dürfte dies der Volatilität im Allgemeinen förderlich sein und konvexe Ansätze begünstigen, wie wir sie in unser Portfolio aufnehmen wollen. Solche Strategien können auch einen wertvollen Schutz für den Fall bieten, dass unerwartete Risiken auftreten. In einem Umfeld mit so bedeutenden strukturellen Veränderungen und der damit verbundenen Unsicherheit, in dem wir uns heute befinden, ist dies besonders wichtig. Das Gleiche gilt ebenfalls für dynamische Strategien wie Short Term Trading. Bei Währungen, Zinssätzen und Anleihen sehen wir zweifelsohne immer noch Bewegungen in einer großen Bandbreite. Unsere Strategien werden zwar nicht immer richtig liegen, aber wenn wir, wie im Jahr 2022, mehr richtig als falsch liegen, dann haben anhaltende Ausbrüche aus diesen Bandbreiten und kurzfristige Dynamiken das Potenzial, die Rendite zu steigern.

\* Bei der Benchmark handelt es sich um einen Cash Index. Die Wertentwicklung des Portfolios ist nicht darauf ausgelegt, die Wertentwicklung der Benchmark abzubilden oder zu replizieren.

## US Equity – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamtertragsrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -26,01 %. Der als Benchmark dienende S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von -18,51 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Der gesamte Aktienmarkt, was sich an der Gesamtertragsrendite des Index ablesen lässt, erzielte im Berichtszeitraum schwache Ergebnisse. Während die US-Notenbank (die „Fed“) die steigende Inflation zunächst als „vorübergehend“ bezeichnete, war dies nicht der Fall. Robuste Verbraucherausgaben, Engpässe in der Lieferkette, die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine und andere Faktoren haben die Inflation in den USA auf ein 40-jähriges Hoch getrieben. Vor diesem Hintergrund begann die Fed im März 2022 mit einer aggressiven Kampagne der Zinserhöhungen, die sie voraussichtlich fortsetzen wird, bis die Inflation unter Kontrolle ist und selbst dann, wenn dies zu einer Rezession führt. In Verbindung mit der Sorge um sinkende Unternehmensgewinne führte dies zu Zeiten mit einer verstärkten Risikoscheu.

Wir teilen die Anlagen des Teilfonds auf der Long-Seite in drei Kategorien ein: Kapitalwachstum, Total Return und opportunistische Anlagen. Die Anlagen in der Gruppe Kapitalwachstum zeichnen sich durch attraktive Branchenfundamentaldaten, starke Wettbewerbspositionen, steigende Umsätze und attraktive Wiederanlagechancen aus. Total-Return-Anlagen zeichnen sich durch nachhaltige und/oder wachsende Ertragsströme aus, denen Vermögenswerte zugrunde liegen und die wachsende Barrenditen für die Aktionäre erzielen können (z. B. erhöhte Dividenden, Aktienrückkäufe, Kapitalrendite). Opportunistische Anlagen sind Anlagen mit identifizierbaren Impulsgebern. Diese Kategorie kann Unternehmen mit Managementwechseln, Umstrukturierungen des Unternehmens, Fusions- und Übernahmeaktivitäten, „verborgenen Anlagen“ oder anderen Marktverwerfungen enthalten, die das Potenzial haben, intrinsischen Wert freizusetzen.

Im Berichtszeitraum schnitt das Portfolio schlechter ab als der Index. Die relativen Ergebnisse wurden sowohl durch die Einzeltitelauswahl als auch die Sektorallokation beeinträchtigt. Aus Sicht der Einzeltitelauswahl trugen Positionen im Sektor Nicht-Basiskonsumgüter am meisten zur relativen Performance bei. Umgekehrt schmälerte die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Finanzen und Industrie die Rendite am stärksten. In Bezug auf die Sektorallokation beeinträchtigten eine Untergewichtung gegenüber dem Index im Energiesektor und eine Übergewichtung von IT die Wertentwicklung. Im Gegensatz dazu lieferte die Übergewichtung des Portfolios von Barmitteln den größten Beitrag zur Performance.

Zu Beginn des Jahres 2023 ist uns die Abschwächung der Wirtschaft bewusst. Die Hauptdebatte bezieht sich jedoch darauf, wie stark sich die Wirtschaft abschwächt und wie schnell die Inflation besser kontrollierbare Niveaus erreicht. Es gibt zwei konkurrierende Einschätzungen dazu, wie es weitergehen wird. Einerseits haben wir eine eher früher als später den Höhepunkt erreichende Inflation, die der Fed eine Wende erlaubt und somit zu einer weichen Landung führt. Auf der anderen Seite haben wir eine unnachgiebige Fed, die die Inflation sehr aggressiv eindämmt, was in der Folge zu einem längeren Wirtschaftsabschwung, einem schwächelnden Verbraucher und Gewinnkorrekturen bei vielen Unternehmen führt. Im Moment scheint der Markt der Überzeugung zu sein, dass die Fed einen Fehler begeht und die Geldpolitik zu aggressiv anzieht. Gleichzeitig sind jedoch erste Anzeichen dafür auszumachen, dass die Inflation ihren Höhepunkt überschritten hat, und die Gewinnschätzungen des S&P 500 für 2023 gehen immer weiter zurück. Angesichts der sich verlangsamenden Inflation und des schwächelnden Verbrauchers sehen sich die Unternehmen mit potenziellen Umsatzdruck konfrontiert. Gleichzeitig werden davon jedoch die Margen profitieren, da sich die Kosten und Lagerbestände weiter normalisieren. Die entscheidende Frage ist daher, wie stark ein eventueller Gewinnrückgang ausfallen wird. In einem typischen Abschwung gehen die Gewinne des S&P 500 vom Höchststand bis zum Tiefpunkt um etwa 25 % zurück. Prognostik, Budgetierung und die Zuweisung knapper Ressourcen sind noch nie so nuanciert gewesen wie heute, insbesondere vor dem Hintergrund des beispiellosen und unerwarteten Nachfrageanstiegs in den Jahren 2020 und 2021. Unserer Ansicht nach ist die zukünftige Herausforderung in puncto Modellierung für die Fed ebenso groß wie für das lokale Restaurant.

Nichtsdestotrotz sind wir uns der komplexen Welt, in der wir leben und investieren, bewusst. Angesichts der massiven weltweiten Konjunkturprogramme besteht das Risiko, dass die zugrunde liegende Annahme einer sehr niedrigen Inflation falsch sein könnte, denn unkontrollierte Haushaltsausgaben haben irgendwann Konsequenzen. Wir weisen auf diese Risiken hin, weil das aktuelle Umfeld in der komplexen, globalen Welt, in der wir tätig sind, wie immer einen flexiblen Ansatz erfordert. Darüber hinaus sind wir fest überzeugt, dass die größten Risiken für die Weltwirtschaft immer noch diejenigen sind, die heute noch unbekannt sind – seien sie finanzieller oder geopolitischer Natur. Wie immer müssen wir bereit und fähig sein, uns anzupassen, wenn sich Fakten ändern.

## US Equity Index PutWrite – Bericht des Investment-Managers

Für die zwölf Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamttrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -10,63 %. In demselben Zeitraum verzeichnete die sich zu je 50 % aus dem Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index und dem Cboe S&P 500 PutWrite Index (zusammen der „Index“) zusammengesetzte Benchmark -10,94 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamttrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Seit dem 19. August 2022 vergleicht das Portfolio seine Wertentwicklung mit dem Index und nicht mehr wie bisher – 42,5 % Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index, 42,5 % Cboe S&P 500 PutWrite Index, 7,5 % Cboe Russell 2000 One-Week PutWrite Index und 7,5 % Cboe Russell 2000 PutWrite Index –, da der Index Merkmale aufweist, die für die Anlagestrategie des Portfolios repräsentativer sind als sein vorheriger Index. Seit dem Börsenschluss am 19. August 2022 (dem Datum des Inkrafttretens der Änderung) bis zum Ende des Berichtszeitraums erzielte die thesaurierende Klasse USD I eine Rendite von -4,26 % und übertraf damit den Index, der -6,16 % erzielte. Für den gesamten Berichtszeitraum erzielte die thesaurierende Klasse USD I eine Rendite von -10,63 %. Sie übertraf damit den vorherigen Index, der im Berichtszeitraum auf eine Rendite von -11,25 % kam.

Trotz einer weiteren Straffung um 125 Bp durch die US-Notenbank im vierten Quartal versuchten die Finanzmärkte, das Jahr 2022 mit Gewinnen auf breiter Front zu retten. Trotz der Erholung während der Feriensaison beendete der S&P 500 Index das Jahr 2022 jedoch mit einer Rendite von -18,11 % im negativen zweistelligen Bereich. Das Jahr lässt sich mit einer einzigen Statistik beschreiben: 2022 hatte die meisten monatlichen Renditen von +/- 8 % seit 1939. Die Equity Index PutWrite Indizes entwickelten sich wie geplant und beendeten das Jahr deutlich besser als ihre zugrunde liegenden Aktienindexpositionen. Insbesondere sei der Cboe S&P 500 PutWrite Index („PUT“) erwähnt, der um bescheidene -7,66 % zurückging, nachdem er von einigen „glücklichen“ monatlichen Rolloptionen profitiert hatte. Die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere erlitten im Jahresverlauf ein ähnliches Schicksal wie die Aktienmärkte: Der Bloomberg US Aggregate Index und der Bloomberg US Corporate High Yield Index mussten Verluste von -13,01 % bzw. -11,19 % hinnehmen. Die kurzfristigen Indexrenditen von kurzlaufenden US-Staatsanleihen trotzten dem Inflationssturm, wobei der ICE BofA U.S. 3-Month T-Bill Index („ICE 3M USB“) im Jahresverlauf eine attraktive Rendite von 1,46 % verbuchte. Im vierten Quartal kamen alleine 84 Bp hinzu. Die etwas längere Duration des ICE BofA 1-3 Year US Treasury Index („CE 1-3Y UST“) stieg im vierten Quartal um 73 Bp, blieb aber im Jahresverlauf mit -3,65 % im negativen Terrain. Diese Performancedifferenz im Jahr 2022 war der wichtigste Gegenwind für die relative Wertentwicklung des Portfolios, da passive Optionsstrategie-Indizes in der Regel 1- bis 3-monatige US-T-Bills als Sicherheiten halten.

Im Allgemeinen sind wir der Auffassung, dass die Performance des Portfolios den Erwartungen für den Berichtszeitraum entsprochen hat. Dennoch erwiesen sich die beispiellosen Zinserhöhungen im Jahr 2022 als eine gewisse Herausforderung für die relative Performance gegenüber den Indizes der Optionsstrategien. Wir haben die Duration des Sicherheitenportfolios des Portfolios bis Ende 2021 auf etwa 1 Jahr reduziert, doch war 2022 jedes Durationsengagement nachteilig. Der ICE 1-3Y UST erzielte im Berichtszeitraum eine Rendite von -3,65 %, was erst das zweite Kalenderjahr seit 1978 mit einem Minus war. 2021 war mit einem bescheidenen Verlust von -0,55 % das erste Minusjahr. In krassm Gegensatz dazu führte die positive Rendite des ICE 3M USB von 1,46 % zu einer erheblichen relativen Underperformance des ICE 1-3Y UST mit einer Differenz von -511 Basispunkten. Wichtig ist, dass die Streuung der Wertentwicklung zwischen kurzlaufenden US-Staatsanleihen im Jahr 2022 im Wesentlichen für die meiste Underperformance des Portfolios gegenüber dem PUT-Index verantwortlich ist, der US-T-Bills als Sicherheiten hält. Die gute Nachricht ist, dass die im Jahr 2022 erlittenen Verluste des Sicherheitenportfolios zum größten Teil auf die Marktbewertung zurückzuführen sind. Die abgezinsten Positionspreise sollten bei Fälligkeit wieder auf den Nennwert ansteigen. Im Jahresverlauf wurde die Gesamtleistung durch die Strategie S&P 500 PutWrite des Portfolios und durch das Sicherheitenportfolio beeinträchtigt. Seit Jahresbeginn ist der Fonds um -10,63 % gefallen, verglichen mit der Indexrendite von -10,94 %, da er einen Großteil des Verlusts des S&P 500 (-18,11 %) vermeiden konnte. In der Zwischenzeit sank der wöchentliche PutWrite, gemessen am Cboe S&P 500 One-Week PutWrite („WPUT“), deutlich um -14,25 %, und der Cboe S&P 500 BuyWrite Index („BXM“) fiel um -11,37 %. Im gleichen Zeitraum verzeichnete das Sicherheitenportfolio einen leichten Rückgang und hinkte der Rendite des ICE BofA US 0-3-Month US Treasury Index von 1,53 % hinterher. Im bisherigen Jahresverlauf gab es keine positiven Beiträge zur Performance des Portfolios.

Angesichts des jährlichen Zyklus der Finanz- und Wirtschaftsprognosen glauben wir, dass das nächste Jahrzehnt weitaus schwieriger sein wird als das letzte. Die Anleger sehen sich mit einer Kombination von Risiken konfrontiert, die wir in unserer Laufbahn noch nie gesehen haben, wenn überhaupt. Konkret müssen sie sich mit einem „dreieckigen Dutzend“ auseinandersetzen: höhere Zinssätze, eine alternde Demografie, eine polarisierte politische Landschaft, unsichere Inflation, Pandemiopolitik, ESG-Regulierung (soziale Besteuerung), Energie-/Rohstoffunsicherheit, dezentrales Finanzwesen („DeFi“), Klimakatastrophen, soziale Medien (Verschwörungen), abnehmende finanzielle Liquidität und bewaffnete Konflikte (Krieg hat viele moderne Namen). Jeder dieser Faktoren wird sich potenziell auf die globalen wirtschaftlichen Entwicklungen des kommenden Jahrzehnts auswirken, doch ist es unmöglich vorherzusagen, welche Kombinationen sich als die wichtigsten wirtschaftlichen Triebkräfte/Einflüsse herausstellen werden. Unabhängig davon glauben wir, dass ihr Zusammentreffen zu einer beispiellosen Volatilitätslandschaft an den Aktienmärkten führen kann, die durch weniger zyklische implizite Volatilitätsniveaus gekennzeichnet ist, die „länger höher“ bleiben könnten. Wir glauben, dass der Cboe S&P 500 Volatility Index („VIX“) immer noch höhere Aktienmarktrisiken einpreist und sich einer Rückkehr auf ein Niveau unter dem langfristigen Durchschnitt widersetzt. Bei einem Anstieg der impliziten Volatilität im Jahresverlauf waren die impliziten Volatilitätsprämien in drei von vier Quartalen positiv. Im gesamten Berichtszeitraum lagen sie bei durchschnittlich 1,42. Schließlich sind wir der Meinung, dass die VIX-Futures-Märkte im Jahr 2023 durch ein anhaltend hohes Niveau der impliziten Aktienvolatilität gekennzeichnet sein könnten.

## US Large Cap Value – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -1,06 %. Im selben Zeitraum verbuchte der Russell 1000 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) ein Plus von -7,54 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Der US-Aktienmarkt sackte im Berichtszeitraum drastisch ab und verzeichnete die schlechteste Rendite seit 2008. Dies war auf eine Reihe von Faktoren zurückzuführen, darunter die hohe Inflation, die im Mai den höchsten Stand seit 40 Jahren erreichte. Dies löste eine drastische Kehrtwende in der Geldpolitik der US-Notenbank (die „Fed“) aus, die im Jahr 2022 sieben Zinserhöhungen von insgesamt 4,25 % vornahm, die höchsten Zinerhöhungen seit 1980. Zudem wurde die Stimmung der Anleger durch die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine, Probleme in der Lieferkette und die Möglichkeit, dass die Maßnahmen der Fed die Wirtschaft in eine Rezession stürzen könnten, negativ beeinflusst. Insgesamt rentierte der S&P 500 Index im Berichtszeitraum -18,11 %. Value-Aktien im Large-Cap-Segment konnten sich dem Marktrückgang auf breiter Front nicht entziehen, doch konnten sie sich im Berichtszeitraum verhältnismäßig besser behaupten (-7,54 %).

Im Berichtszeitraum schnitt das Portfolio besser ab als der Index. Sowohl die Entscheidungen zur Sektorallokation als auch die Einzeltitelauswahl trugen positiv zur relativen Performance des Portfolios bei. Aus Sicht der Sektorallokation trug eine Untergewichtung von Informationstechnologie und Kommunikationsdiensten zusammen mit einer Übergewichtung von Energie am meisten zur Performance bei. Demgegenüber wirkte sich eine Untergewichtung von Nicht-Basiskonsumgütern und eine Übergewichtung von Versorgern leicht negativ aus. In Bezug auf die Einzeltitelauswahl leisteten Bestände in den Sektoren Werkstoffe, Industrie und Gesundheitswesen den größten positiven Beitrag zur relativen Performance des Portfolios. Demgegenüber war die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Finanzen, Basiskonsumgüter und Nicht-Basiskonsumgüter der größte Negativfaktor für die Renditen.

Mit Blick auf die Zukunft gehen wir davon aus, dass der Markt angesichts der vielen Unsicherheiten bis 2023 volatil bleiben wird. Eine dieser Unsicherheiten ist die Frage, wie sich die im Laufe des Jahres 2022 vorgenommene Straffung der Geldpolitik im Jahr 2023 auswirken wird. Die sieben Zinserhöhungen der Fed im Jahr 2022 waren die schnellste geldpolitische Straffung, die viele Anleger je erlebt haben. Zudem ist die weitere Zinsentwicklung noch unklar und wird sich erst im Laufe dieses Jahres entwickeln. Eine weitere Unwägbarkeit ist die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft nach den COVID-Lockdowns und die Frage, wie sich die chinesische Wirtschaft darstellen wird, wenn die Aktivität wieder zunimmt und die Wirtschaft angekurbelt wird. All dies bedeutet, dass der Wechsel an den vordersten Plätzen des Marktes wahrscheinlich nicht geradlinig erfolgen wird. Wir haben die Auswirkungen einer schwächeren Wirtschaft, und wie dies sich auf das Gewinnpotenzial bei einigen der stärker konjunkturabhängigen Unternehmen im Portfolio auswirken kann, aktiv beurteilt. Ferner behalten wir Bewertungen und Gelegenheiten an den Märkten weiterhin genau im Auge. Nach unserer Einschätzung könnten wir in den kommenden Monaten weiterhin mit einer erhöhten Volatilität konfrontiert werden. Vor diesem Hintergrund sind wir der Meinung, dass entsprechende Asset-Allokationen von höchster Bedeutung sind.

## US Long Short Equity – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamtertragsrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -7,67 %. Die als Benchmark dienenden zwei Indizes, der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) und der HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD) verbuchten im selben Zeitraum ein Plus von -18,51 % bzw. -3,18 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Der gesamte Aktienmarkt, was sich an der Gesamtertragsrendite des S&P 500 Index ablesen lässt, erzielte im Berichtszeitraum schwache Ergebnisse. Während die US-Notenbank (die „Fed“) die steigende Inflation zunächst als „vorübergehend“ bezeichnete, war dies nicht der Fall. Robuste Verbraucherausgaben, Engpässe in der Lieferkette, die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine und andere Faktoren haben die Inflation in den USA auf ein 40-jähriges Hoch getrieben. Vor diesem Hintergrund begann die Fed im März 2022 mit einer aggressiven Kampagne der Zinserhöhungen, die sie voraussichtlich fortsetzen wird, bis die Inflation unter Kontrolle ist und selbst dann, wenn dies zu einer Rezession führt. In Verbindung mit der Sorge um sinkende Unternehmensgewinne führte dies zu Zeiten mit einer verstärkten Risikoscheu.

Wir teilen die Anlagen des Teilfonds auf der Long-Seite in drei Kategorien ein: Kapitalwachstum, Total Return und opportunistische Anlagen. Die Anlagen in der Gruppe Kapitalwachstum zeichnen sich durch attraktive Branchenfundamentaldaten, starke Wettbewerbspositionen, steigende Umsätze und attraktive Wiederanlagechancen aus. Total-Return-Anlagen zeichnen sich durch nachhaltige und/oder wachsende Ertragsströme aus, denen Vermögenswerte zugrunde liegen und die wachsende Barrenditen für die Aktionäre erzielen können (z. B. erhöhte Dividenden, Aktienrückkäufe, Kapitalrendite). Die Kategorie der Total-Return-Anlagen schließt auch festverzinsliche Anlagen ein, die sich gegenwärtig überwiegend aus Hochzinstiteln zusammensetzen. Opportunistische Anlagen sind Anlagen mit identifizierbaren Impulsgebern. Diese Kategorie kann Unternehmen mit Managementwechseln, Umstrukturierungen des Unternehmens, Fusions- und Übernahmeaktivitäten, „verborgenen Anlagen“ oder anderen Marktverwerfungen enthalten, die das Potenzial haben, intrinsischen Wert freizusetzen. Short-Positionen können zur Renditesteigerung und/oder Risikoreduzierung eingesetzt werden. Die Mischung ist dabei zum Teil durch das Umfeld bestimmt, in dem das Portfolio tätig ist: Fundamentale Shorts (unternehmensspezifische Wertpapiere) können durch Ideen mit Katalysatorwirkung, potenzielle Gewinnverfehlungen, Veränderungen in der Wettbewerbslandschaft und/oder thematische Shorts, als einige Beispiele, gekennzeichnet sein. „Markt-Shorts“ werden in dem Bemühen eingesetzt, das Risiko zu verwalten und die Risiken des breiteren Marktes zu reduzieren.

Long-Positionen in Aktien blieben im Berichtszeitraum hinter dem Index zurück, was vor allem auf die Wertpapierauswahl in den Sektoren Industrie, Finanzen und Energie zurückzuführen war. Auf der Long-Seite verbuchten die Kategorien Kapitalwachstum, Total Return (Festzinsanlagen unbegriffen) und Opportunistisch negative Beiträge. Im Gegensatz dazu waren einzelne Short-Positionen in bestimmten Titeln und das Short-Engagement im Markt zur Absicherung des Portfolios der Performance hilfreich, was zum Teil auf den allgemeinen Rückgang des Marktes im Berichtszeitraum zurückzuführen war.

Zu Beginn des Jahres 2023 ist uns die Abschwächung der Wirtschaft bewusst. Die Hauptdebatte bezieht sich jedoch darauf, wie stark sich die Wirtschaft abschwächt und wie schnell die Inflation besser kontrollierbare Niveaus erreicht. Es gibt zwei konkurrierende Einschätzungen dazu, wie es weitergehen wird. Einerseits haben wir eine eher früher als später den Höhepunkt erreichende Inflation, die der Fed eine Wende erlaubt und somit zu einer weichen Landung führt. Auf der anderen Seite haben wir eine unnachgiebige Fed, die die Inflation sehr aggressiv eindämmt, was in der Folge zu einem längeren Wirtschaftsabschwung, einem schwächelnden Verbraucher und Gewinnkorrekturen bei vielen Unternehmen führt. Im Moment scheint der Markt der Überzeugung zu sein, dass die Fed einen Fehler begeht und die Geldpolitik zu aggressiv anzieht. Gleichzeitig sind jedoch erste Anzeichen dafür auszumachen, dass die Inflation ihren Höhepunkt überschritten hat, und die Gewinnschätzungen des S&P 500 für 2023 gehen immer weiter zurück. Angesichts der sich verlangsamenden Inflation und des schwächelnden Verbrauchers sehen sich die Unternehmen mit potenziellen Umsatzdruck konfrontiert. Gleichzeitig werden davon jedoch die Margen profitieren, da sich die Kosten und Lagerbestände weiter normalisieren. Die entscheidende Frage ist daher, wie stark ein eventueller Gewinnrückgang ausfallen wird. In einem typischen Abschwung gehen die Gewinne des S&P 500 vom Höchststand bis zum Tiefpunkt um etwa 25 % zurück. Prognostik, Budgetierung und die Zuweisung knapper Ressourcen sind noch nie so nuanciert gewesen wie heute, insbesondere vor dem Hintergrund des beispiellosen und unerwarteten Nachfrageanstiegs in den Jahren 2020 und 2021. Unserer Ansicht nach ist die zukünftige Herausforderung in puncto Modellierung für die Fed ebenso groß wie für das lokale Restaurant. Wie immer setzen wir unsere Anstrengungen zum bestmöglichen Verständnis unternehmens- und portfoliospezifischer Faktoren fort, da dieses Umfeld unseres Erachtens vom Zusammenwirken einer Vielzahl von Faktoren wie fiskalpolitische Überlegungen, geldpolitische Anreize, Sorgen um die öffentliche Gesundheit, geopolitische Unsicherheit, Rohstoffpreisvolatilität, Inflationsdynamik und den gesteuerten Neustart der Wirtschaft geprägt ist. Bei Änderungen in der Marktdynamik kann dies zu einer Verzerrung der Marktwerte von Unternehmen von ihren langfristigen potenziellen Werten führen und potenzielle Gelegenheiten auf Long- und Short-Seite schaffen.

Nichtsdestotrotz sind wir uns der komplexen Welt, in der wir leben und investieren, bewusst. Wir weisen auf diese Risiken hin, weil das aktuelle Umfeld in der komplexen, globalen Welt, in der wir tätig sind, wie immer einen flexiblen Ansatz erfordert. Darüber hinaus sind wir fest überzeugt, dass die größten Risiken für die Weltwirtschaft immer noch diejenigen sind, die heute noch unbekannt sind – seien sie finanzieller oder geopolitischer Natur. Wie immer müssen wir bereit und fähig sein, uns anzupassen, wenn sich Fakten ändern.

## US Multi Cap Opportunities – Bericht des Investment-Managers

Für die 12 Monate zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“) belief sich die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -17,11 %. Der als Benchmark dienende S&P 500 (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von +18,51 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Das Portfolio schnitt im Berichtszeitraum besser ab als der Index. Es übertraf den Index sowohl im 3. als auch im 4. Quartal 2022. In der zweiten Jahreshälfte erzielte das Portfolio eine Rendite von 7,28 %, eine Outperformance des Index um 524 Basispunkte. Die Titelauswahl war die entscheidende Antriebskraft hinter der Outperformance für das Jahr. Die starke Einzeltitelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienstleistungen, Nicht-Basiskonsumgüter und Informationstechnologie kam der relativen Performance zugute. Die Auswahl innerhalb des Grundstoffsektors beeinträchtigte die relative Performance. Das fehlende Engagement des Portfolios im Energiesektor war der größte Negativfaktor für die relative Performance im Berichtszeitraum. Eine Übergewichtung von Nicht-Basiskonsumgütern und eine Untergewichtung des Gesundheitswesens hatten ebenfalls einen negativen Effekt. Das Portfolio profitierte von einer untergewichteten Position in Informationstechnologie und übergewichteten Positionen in Basiskonsumgütern, Finanztiteln, Industrie und Werkstoffen sowie von einer Nullgewichtung von Immobilien. Das Portfolio beendete das Geschäftsjahr mit einer Übergewichtung in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Finanzen und Werkstoffe sowie einer Untergewichtung im Gesundheitswesen und in der Informationstechnologie und hatte kein Engagement in der Energie oder Immobilien.

Die Zusammensetzung des Portfolios ist eine wichtige Komponente in unserem Anlageprozess, und wir finden nach wie vor attraktive Chancen in unseren drei Anlagekategorien: Special Situation-, opportunistische und klassische Investments. Dieser ausgewogene Ansatz dient dazu, die Risiken zu mindern und gleichzeitig durch die Einzeltitelauswahl unter verschiedenen Marktbedingungen ein Renditepotenzial zu generieren. Wir entdecken weiter in jeder Kategorie attraktive Chancen.

Der Kern unseres Anlageprozesses ist ein konsequenter Fokus auf der Generierung eines freien Cashflows bei einem Unternehmen und seine Verwendung durch die Unternehmensleitung. Wir sind der Meinung, dass der freie Cashflow ein besserer Maßstab für die Wertschöpfung ist als die Gewinn- und Verlustrechnung. Unsere Analyse berücksichtigt die Stabilität und die Treiber des freien Cashflows sowie die Verwendungsmöglichkeiten für dieses Kapital. Dieser Anlageschwerpunkt gibt uns die Möglichkeit, Chancen in allen Sektoren, Marktkapitalisierungen und Risikoprofilen auszumachen, insbesondere in Phasen erhöhter Marktvolatilität.

Wir wenden weiterhin ein diszipliniertes fundamentales Research zur Ermittlung qualitativ hochwertiger Geschäftsmodelle mit attraktiven freien Cashflow-Merkmalen, die zu überzeugenden Bewertungen gehandelt werden, an. Unser Fokus auf den freien Cashflow kann in einem von höheren Zinsen geprägten Umfeld vorteilhaft sein. Wir glauben, dass höhere Zinssätze und die damit verbundenen Marktanpassungen zu einer differenzierten Aktienkursentwicklung führen, was für unseren aktiven Ansatz günstig ist. Auf den freien Cashflow ausgerichtete Unternehmen haben einen potenziellen Vorteil: Sie sind weniger von den Kapitalmärkten abhängig und können in der Lage sein, Wachstumsinitiativen selbst zu finanzieren. Unser disziplinierter, auf den freien Cashflow ausgerichteter Ansatz, unser Verständnis von Kapitalstrukturen, Bewertungsdisziplin und unsere ausgewählte Beteiligungen im Finanzsektor bieten im gegenwärtigen Umfeld einen potenziellen Vorteil.

Wir glauben, dass unsere Anlagestrategie fähig ist, langfristigen Wert für Kunden zu schaffen. Die makroökonomische Unsicherheit könnte im Jahr 2023 potenziell abnehmen, was unserer Strategie zugute kommen könnte. Dazu gehören die Verbesserung der Lieferkette, eine Verlangsamung der Inflationsrate, die Stabilisierung der Rohstoffpreise, die mögliche Beilegung geopolitischer Spannungen, Klarheit über die Ausgabendrends im Zuge der unternehmerischen Gewinnmeldungen und die anhaltende Transparenz der weltweiten Zentralbanken hinsichtlich des Tempos der Zinserhöhungen. Die Aktienbewertungen sind für ausgewählte Unternehmen im vergangenen Jahr günstiger geworden. In einem sich verändernden Marktumfeld sind wir davon überzeugt, dass unser Bottom-up-Ansatz und unsere Fähigkeit, die spezifischen Chancen individueller Unternehmen zu verstehen, von Vorteil sind. Ausgewählte Unternehmen sind in der Lage, sich mit unternehmensspezifischen Lösungen als Reaktion auf makroökonomische und branchenbezogene Ereignisse von ihren Konkurrenten abzuheben. Wir sind überzeugt, dass das Portfolio gut positioniert ist, da sich die Anleger zunehmend auf die unternehmerischen Fundamentaldaten konzentrieren.

Da wir sowohl potenzielle neue Portfoliositionen als auch aktuelle Bestände bewerten, werden wir dies auch in Zukunft unter Berücksichtigung einer langfristigen Anlageperspektive tun. Unser Schwerpunkt liegt stets auf darauf, das Vermögen unserer Kunden durch die disziplinierte Anwendung unserer Anlagephilosophie und unseres Anlageverfahrens zu steigern.

## US Real Estate Securities – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamtrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -28,01 %. Der FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte während des gleichen Zeitraums -25,71 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Der US-Aktienmarkt, gemessen am S&P 500 Index, sackte im Berichtszeitraum drastisch ab und verzeichnete die schlechteste Rendite seit 2008. Dies war auf eine Reihe von Faktoren zurückzuführen, darunter die hohe Inflation, die im Mai den höchsten Stand seit 40 Jahren erreichte. Dies löste eine drastische Kehrtwende in der Geldpolitik der US-Notenbank (Fed) aus, die im Jahr 2022 sieben Zinserhöhungen von insgesamt 4,25 % bis 4,50 % vornahm, die höchsten Zinserhöhungen seit 1980. Zudem wurde die Stimmung der Anleger durch die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine, Probleme in der Lieferkette und die Möglichkeit, dass die Maßnahmen der Fed die Wirtschaft in eine Rezession stürzen könnten, negativ beeinflusst. **Insgesamt verbuchte der S&P 500 Index in dem sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 -18,11 %.** Demgegenüber legte der FTSE Nareit All Equity REITs Index (USD Total Return, vor Abzug von Gebühren, abzüglich Steuern, USD) im selben Zeitraum um -24,95 % zu.

Im Berichtszeitraum schnitt das Portfolio schlechter ab als der Index. Sowohl die Einzeltitelauswahl als auch die Sektorallokation beeinträchtigten die relativen Portfoliorenditen. Aus Sicht der Einzeltitelauswahl lieferten die Portfoliobestände in den Sektoren Diversifiziert, Gesundheitswesen und Wohnungen den größten Negativbeitrag zu den Ergebnissen. Im Gegensatz dazu trugen Positionen in den Sektoren Spezialobjekte, Büroraum und Selbsteinlagerung am meisten zur Performance bei. Im Hinblick auf die Sektorpositionierung beeinträchtigten die Untergewichtungen von Spezialobjekten und freistehenden Häusern die Renditen am stärksten. Umgekehrt trugen eine Untergewichtung von Büroraum und eine kleine Barmittelposition am meisten zur Performance bei.

Zu Beginn des Jahres 2023 sind wir vorsichtig, da das makroökonomische Umfeld durch die Inflation, eine aggressivere Politik der Fed – sie ist entschlossen, die Inflation unter Kontrolle zu bringen – und ein langsames Wirtschaftswachstum sowie einen Mangel an Liquidität sowohl auf den Transaktionsmärkten als auch bei privaten Anlageinstrumenten belastet wird. Die Weltwirtschaft scheint sich abzuschwächen, was an der Verlangsamung des Wohnungsbaus und das geringe Vertrauen der Unternehmen ablesbar ist. Wir glauben jedoch, dass die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft, niedrigere Energie- und Rohstoffpreise und ein sich abschwächender Arbeitsmarkt die Ansicht unterstützen könnten, dass die Inflation ihren Höhepunkt erreicht hat. Erhöhte Kapitalkosten für REITs, gepaart mit dem Potenzial für eine Verlangsamung der Fundamentaldaten im Fahrwasser einer robusten Vermietungsperiode 2021/2022, werden wahrscheinlich die Geschäftsentscheidungen verzögern und die Gesamtnachfrage und das Ertragswachstum für REITs belasten. Unserer Meinung nach werden der Immobiliensektor und die Wertpapierauswahl wichtige Alpha-Beiträge leisten, und zwar mehr als in der Vergangenheit. Wir glauben, dass der Großteil der REITs auf eine erhebliche Störung der Unternehmensnachfrage vorbereitet ist, mit starken Bilanzen, einer relativ geringen Neubautätigkeit und verschiedenen Nachfragefaktoren, die eher defensiven Charakters sind. Die rasche Umkehrung der Mittelbeschaffung bei nicht börsennotierten REITs und die Welle von Rücknahmeanträgen könnte REITs die Gelegenheit bieten, ausgewählte Vermögenswerte zu relativ attraktiven Bewertungen zu erwerben.

## US Small Cap – Bericht des Investment-Managers

Für die zum 31. Dezember 2022 endenden zwölf Monate belief sich die Gesamrendite der Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I auf -19,25 %. Im selben Zeitraum verbuchte der Russell 2000 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) ein Plus von -20,76 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Der US-Aktienmarkt sackte im Berichtszeitraum drastisch ab und verzeichnete die schlechteste Rendite seit 2008. Dies war auf eine Reihe von Faktoren zurückzuführen, darunter die hohe Inflation, die im Mai den höchsten Stand seit 40 Jahren erreichte. Dies löste eine drastische Kehrtwende in der Geldpolitik der US-Notenbank (die „Fed“) aus, die im Jahr 2022 sieben Zinserhöhungen von insgesamt 4,25 % vornahm, die höchsten Zinerhöhungen seit 1980. Zudem wurde die Stimmung der Anleger durch die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine, Probleme in der Lieferkette und die Möglichkeit, dass die Maßnahmen der Fed die Wirtschaft in eine Rezession stürzen könnten, negativ beeinflusst. Insgesamt rentierte der Index -20,76 %, während der S&P 500 Index im Berichtszeitraum auf -18,11 % kam.

Das Portfolio erzielte eine negative absolute Rendite, übertraf aber die Benchmark im Berichtszeitraum. Dies war auf eine starke Einzeltitelauswahl zurückzuführen, die teilweise durch die negative Sektorallokation kompensiert wurde. In Bezug auf die Einzeltitelauswahl kamen die stärksten relativen Ergebnisse aus den Sektoren Informationstechnologie („IT“) und Finanzen. Innerhalb des IT-Bereichs trugen unsere Software-Titel am meisten zur Rendite bei. Unsere Beteiligungen im Technologiesektor sind dadurch gekennzeichnet, dass die Unternehmen in einem Segment mit hohen Eintrittsbarrieren operieren, starke freie Cashflows generieren und attraktive Wachstumschancen aufweisen, vor allem aufgrund von unternehmensspezifischen Innovationen und die unternehmenskritische Natur ihrer Produkte. Umgekehrt sind viele der in der Benchmark vertretenen Unternehmen mehr spekulativer Natur und für ihr Wachstum von den Kapitalmärkten abhängig. Wir haben gesehen, dass diese Arten von Aktien in diesem Jahr unter erheblichem Druck standen, da die Kapitalmärkte in Bezug auf solche Unternehmen kritischer wurden, die nicht die Fähigkeit zeigten, rentabel zu werden. Im Finanzsektor setzten sich unsere Positionen in Versicherungen und Banken an die Spitze. Umgekehrt dämpfte die Titelauswahl in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Basiskonsumgüter die relativen Ergebnisse am meisten. Bei Nicht-Basiskonsumgütern wurde die Schwäche einiger großer Positionen durch die Befürchtung einer nachlassenden Endmarktnachfrage belastet. Bei Basiskonsumgütern wurden unsere Unternehmensbeteiligungen in den Bereichen Nahrungsmittel und Haushaltsprodukte nicht belohnt. Bei der Sektorallokation wirkten sich unsere Untergewichtung des Energiesektors und unsere Übergewichtung des IT-Sektors negativ auf die relativen Ergebnisse aus. Dies wurde teilweise durch den Vorteil einer Untergewichtung von Biotechnologieunternehmen und Real Estate Investment Trusts (REITs) wettgemacht.

Die Fed konzentriert sich eindeutig auf die Wiederherstellung der Preisstabilität durch die Erhöhung der Leitzinsen in der Erwartung, dass dies die Nachfrage senken und die Inflation wieder unter Kontrolle bringt. Ihr Ziel, die Preisstabilität auf Kosten des Wirtschaftswachstums und einer höheren Arbeitslosigkeit wiederherzustellen, führt weiterhin zu negativen Gewinnkorrekturen, niedrigeren KGV-Multiplikatoren und letztendlich zu niedrigeren Aktienkursen. Darüber hinaus sorgen der stärkere US-Dollar, die schwächeren Einzelhandelsausgaben, das sinkende Vertrauen der Verbraucher/Unternehmen und der anhaltende Konflikt in der Ukraine auch weiterhin für ein erhöhtes Maß an Unsicherheit und damit für zusätzliche Volatilität. Insgesamt hat dies zur Erhöhung der Sorgen um eine potenzielle Rezession in den USA und weltweit geführt. Da potenzielle makroökonomische Ergebnisse höchst unsicher sind, versuchen wir ein Gleichgewicht im Portfolio in allen Sektoren aufrecht zu erhalten. Wir sind zuversichtlich, dass Anlegen in ein diversifiziertes Portfolio aus finanzstarken Unternehmen mit nachhaltigen und hochdifferenzierten Geschäftsmodellen ein vernünftiger Ansatz für langfristigen Anlageerfolg ist.



## US Small Cap Intrinsic Value – Berichts des Investment-Managers

Für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -20,64 %. Der Russell 2000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von -15,00 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.

Wenn wir über die Wirtschafts- und Marktaussichten für 2023 nachdenken, so ist es klar, dass die Schwierigkeiten des Jahres 2022 und die verbleibenden Herausforderungen größtenteils auf die weltweite Reaktion auf die Pandemie zurückzuführen sind. Von unterbrochenen Lieferketten über Arbeitskräftemangel bis hin zu übermäßigen finanziellen Anreizen – das langfristige Symptom der diversen politischen Reaktionen auf die Pandemie im In- und Ausland war die Inflation. Die Verringerung der Inflation und ihrer schädlichen Auswirkungen auf uns alle ist die wichtigste Aufgabe der US-Notenbank (die „Fed“). Die zukünftige Entwicklung ist von kritischer Bedeutung, wenn wir eine Wirtschaft wie vor der Pandemie anstreben.

Unserer Ansicht nach wurden Fortschritte erzielt. Die Zentralbanker reden jedoch weiterhin die sich verbessernden Inflationsdaten klein und bleiben dabei, dass mehr getan werden muss. In der gesamten Wirtschaftslandschaft sehen wir ermutigende Trends. Die Rohstoffpreise haben sich abgeschwächt, und die Immobilienmärkte kühlen sich rasch ab. Die Nachfrage nach einer Vielzahl von Konsumgütern ist gesunken und der Mangel an Arbeitskräftemangel lässt nach. Die Unternehmen werden nun lange und gründlich nachdenken, bevor sie weitere Preiserhöhungen weitergeben. Das einzige Segment, in dem wir wohl noch keine ausreichende Verbesserung gesehen haben, ist der Dienstleistungssektor. Verbesserungen werden hier noch Zeit brauchen und die Tatsache, dass unsere Wirtschaft zu fast 70 % aus Dienstleistungen besteht, ist zweifellos ein Grund dafür, dass die Fed in ihren öffentlichen Stellungnahmen weiterhin eine restriktive Haltung einnimmt.

So sehr wir auch darauf angewiesen sind, dass die Fed in ihrem Bestreben, die Inflation einzudämmen, erfolgreich ist, so wichtig ist es ebenso, dass dieses Ziel erreicht wird, ohne einen schweren wirtschaftlichen Abschwung zu provozieren. Wir sind eine hoch verschuldete Gesellschaft, und eine tiefe Rezession könnte zweifelsohne das Risiko eines finanziellen Schocks bürden. Bislang hat die Korrektur der Bewertungen von Finanzanlagen aber noch keine tiefen Spuren in der realen Wirtschaft hinterlassen.

Der dramatische Zinsanstieg im Jahr 2022 führte dazu, dass die Märkte die Aktien zu niedrigeren KGV-Multiplikatoren bewerteten und Unternehmen, deren Gewinne in einer Rezession oder aufgrund höherer Zinsaufwendungen sinken würden, zusätzliche Abschläge in ihrer Bewertung hinnehmen mussten. Während des gesamten Jahres 2022 wiesen die Unternehmen auf die Schwierigkeiten hin, mit denen sie bei der Betriebsführung konfrontiert waren. Teilemangel, erhöhte Logistik- und Arbeitskosten sowie ein Anstieg der Rohstoffkosten wurden häufig als Gründe für enttäuschende Gewinne genannt. Im Laufe des Jahres, als die Zinssätze und der Dollarkurs stiegen, kamen Wechselkursschwankungen und höhere Kreditkosten zur Liste der zu bewältigenden Probleme hinzu.

Trotz dieser Hindernisse übertraf oder entsprach fast die Hälfte der Portfolioerträge den Erwartungen der Analysten vor Jahresbeginn. Etwa 44 % des Portfolios übertrafen die Konsensertragschätzung und weitere 5 % entsprachen den Erwartungen. Es überrascht jedoch nicht, dass die andere Hälfte des Portfolios, in der die Erträge nach unten korrigiert wurden, für die gesamte negative Rendite für 2022 verantwortlich war.

Wenn man sich ansieht, welche Investitionen funktioniert haben, so ist die Schlussfolgerung ziemlich eindeutig – alles, was wir im Energiesektor gemacht haben, hat funktioniert, und in einem viel geringeren Ausmaß im Gesundheitswesen ebenso. Trotz des Ausverkaufs im Sektor Informationstechnologie profitierten wir von unseren Anlagen in Softwareunternehmen, die wir zu attraktiven Bewertungen erworben hatten. Gleiches gilt für eine Anlage in Hardware, Rambus, mit positiven Gewinn- und Umsatzrevisionen. Allerdings war es auch der Fall, dass der Gegenwind 2022 stärker war je mehr Technologiewerte man besaß.

Angesichts der überproportionalen Auswirkungen negativer Gewinnrevisionen auf die Performance im Jahr 2022 lohnt sich der Blick auf die Ursachen für die enttäuschenden Ergebnisse des Jahres 2022, um die Chancen für eine Erholung und die Erwartungen für 2023 zu verstehen.

Die Unterbrechung der Lieferkette stellte eine große Herausforderung dar und war für mehr als die Hälfte der Negativkorrekturen verantwortlich. Wir haben dies bei mehreren unserer Investitionen in Technologiewerten und der hinreichend bekannt gemachten Chip-Knappheit erlebt. Die Lösung dieses Problems kann einen großen Beitrag zur Verringerung der Ertragsrisiken im Jahr 2023 leisten und die Voraussetzungen für eine Erholung der Performance kreieren. Ein gutes Beispiel ist unsere Investition in Ciena. Da das Unternehmen sich nicht in der Lage sah, kostengünstige Teile im Wert von 5 Mio. USD zu beschaffen, konnte es im Jahr 2022 keine Produkte im Wert von 500 Mio. USD ausliefern. Die Gewinne für 2022 wurden um etwa 1 USD von 3,76 USD auf 2,77 USD nach unten korrigiert und der Aktienkurs von Ciena fiel von 70 USD auf 40 USD. Im letzten Quartal gab das Unternehmen bekannt, dass der Komponentenmangel weitgehend behoben sei und Ciena in der Lage ist, mit einer viel höheren Rate zu produzieren und zu liefern. Die Analysten haben ihre Gewinnsschätzungen für das nächste Geschäftsjahr um fast 1 USD pro Aktie angehoben, und der Titel, der jetzt bei 50 USD gehandelt wird, hat ein Drittel seiner verlorenen Bewertung wieder aufgeholt.

Rohstoffkosten und Wechselkurse spielten bei 40 % der Underperformer eine Rolle. Beide Aspekte sind jetzt tendenziell rückläufig und werden bei einem Höchststand der Zinssätze im kommenden Jahr wahrscheinlich nicht mehr als Grund für eine negative Gewinnkorrektur herangezogen. Weniger als 20 % der Negativbeiträge waren auf Umsatzschwächen zurückzuführen. Die Geschäftsbedingungen, gemessen an den Erträgen, waren für den Großteil des Portfolios stabil. Es stellt sich daher die Frage nach den Aussichten für die Nachfrage im Jahr 2023 – harte oder weiche wirtschaftliche Landung? Unter Ökonomen herrscht Einigkeit darüber, dass die Wirtschaft 2023 oder 2024 wahrscheinlich eine Rezession erleben wird. Wie schwer sie wird hängt davon ab, wie schnell die Fed den Gang wechselt und beginnt, die Geldpolitik zu lockern, anstatt sie weiter zu straffen. Es ist schwierig und offen gesagt für uns auch ein wenig sinnlos, sich dazu zu äußern, ob die Fed das richtige Gleichgewicht zwischen Inflationsbekämpfung und der Aufrechterhaltung eines angemessenen Niveaus von Wirtschaftswachstum und Beschäftigung finden wird. Ehrlich gesagt, sind wir von der Fed etwas enttäuscht, doch wird sich nur im Laufe der Zeit zeigen, ob sie ihr Blatt richtig spielt.

Abgesehen von den Spekulationen über die US-Notenbank sind wir der Meinung, dass die Performance der einzelnen Aktien angesichts der gesunkenen Kurs-Gewinn-Verhältnisse in erster Linie davon abhängen sollte, wie gut die Unternehmen in einer sich abschwächenden Wirtschaft die Gewinnerwartungen erfüllen. Wenn es so etwas wie „risikoreduzierte“ Erwartungen gibt, dann sei angemerkt, dass bei über 50 % unseres Portfolios die Gewinnerwartungen für 2023 gegenüber dem Vorjahr nach unten korrigiert wurden.

## US Small Cap Intrinsic Value – Bericht des Investment-Managers (Fortsetzung)

Im Jahresverlauf konzentrierten sich unsere Aktivitäten eher auf die Aufstockung von Unternehmen mit einer Underperformance und auf die Reduzierung von Gewinnern als auf die Einführung neuer Ideen. Es wurden lediglich zwei Unternehmen dazugekauft: Ping Identity und Mandiant (vormals FireEye). Historisch werden jährlich zwischen fünf und acht Unternehmen aufgenommen, wodurch 5 % bis 10 % des Portfolios für Reinvestitionen frei werden. Auch die Aussichten für Fusionen und Übernahmen im Jahr 2023 sind ungewiss. Im Hintergrund besteht Potenzial, doch sind die Märkte für fremdfinanzierte Kredite praktisch geschlossen, und bei Private-Equity-Firmen und strategischen Käufern herrscht Vorsicht. Kleinere Transaktionen von Käufern auf der Suche nach Technologiewerten, sind wahrscheinlich, doch müssen öffentlichen Käufer sehr darauf achten, ihre Bilanzen nicht übermäßig zu verschulden. Im Jahr 2022 gab es eine Handvoll Transaktionen, die am Markt auf wenig Gegenliebe stießen und bei denen öffentliche Käufer zwischen 20 % und 50 % ihres Aktienwerts verloren hatten, nachdem sie transformative (d. h. große) Akquisitionen angekündigt hatten.

Die sechs neuen Investitionen im Jahr 2022 kamen aus unseren traditionellen Bereichen Technologie und Industrie, in denen eine Kombination aus Komplexität und unterbrochenem Wachstum zu Underperformance geführt hatte. Wir haben in drei Softwareunternehmen (WIX, Varonis und Cerence) sowie in die drei Industrieunternehmen Markforged (3-D-Druck), Arcosa und nLight investiert. Wir stellen fest, dass Private-Equity-Firmen anscheinend Appetit auf hochwertige Softwareunternehmen haben. Sowohl WIX als auch Varonis sind schuldenfreie Unternehmen mit einem sehr starken Produktangebot und soliden langfristigen Nachfrageaussichten. Nach einigen internen Diskussionen und zusätzlichen Treffen mit der Unternehmensführung von Cerence haben wir uns im Dezember 2022 entschlossen, unsere Investition zu beenden. Einfach gesagt vermuten wir, dass das neue Geschäftsmodell des Unternehmens noch mindestens ein Jahr lang keine Dynamik aufbringen wird, und die auf der Analystenkonferenz im November vorgebrachte Erklärung für den drastischen Umsatzrückgang im Jahr 2022 war nicht überzeugend.

Wir sind einem konstruktiven Engagement mit den Unternehmen weiterhin verpflichtet. Im Laufe des Jahres unterzeichneten wir drei Vertraulichkeitsvereinbarungen zwecks der Zusammenarbeit mit dem Management von Portfoliounternehmen, um Strategien zur Verbesserung der Bewertung vorzuschlagen. Wir führten Kapitalerhöhungen bei Ribbon Communications und Quantum durch, reichten eine 13-D für Cognyte Software ein und engagierten uns kürzlich mit dem Management von Unisys. Wir gehen aggressiv vor, wenn wir einen Weg zur schnelleren Lösung der Probleme sehen, mit denen ein Portfoliounternehmen konfrontiert ist.

Nach einer Reihe von drei Jahren mit Renditen von jeweils über 20 % sollte es uns nicht wirklich überraschen, dass wir 2022 die Zeche zahlen mussten. Dessen ungeachtet sind wir aber dennoch ziemlich enttäuscht über das Ergebnis. Eine größere Herausforderung und wichtiger für uns ist ein klarer Weg vorwärts. Die heutige Inflation ist eine direkte Folge der Lösungen, die wir für die Krisen der letzten 15 Jahre gefunden haben. Die Zinsen auf einem Niveau nah Null in Verbindung mit Interventionen der Zentralbank und der US-Regierung haben die Kapitalkosten künstlich gesenkt und das Wirtschaftswachstum aufgebläht. Angesichts einer Zukunft mit höheren Zinssätzen und weniger Spielraum für stimulierende Regierungsprogramme, wird zukünftiges Wachstum von Innovation (Produktivität) und Demographie kommen müssen. Nichts Ungewöhnliches, aber nicht so vorhersehbar, wie manche Anleger es sich wünschen würden.

Alles in allem bleiben wir mit Blick auf die überzeugenden langfristigen Chancen des Small-Cap-Aktienmarktes und unseres Portfolios zuversichtlich. Gleichzeitig sind wir uns aber nicht sicher, ob die Herausforderungen des Jahres 2022 nicht auch im Jahr 2023 bestehen bleiben. Wir danken Ihnen für Ihre Kapitalverpflichtungen, mit denen sie unsere Strategie investiert haben, und werden uns bemühen, Ihre Investition auf intelligente Weise mit einer attraktiven Rendite zu vermehren.

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Aktien 95,96 % (31. Dezember 2021: 97,18 %)</b>			
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
1.078.500	SG Micro Corp Class A	26.904.630	2,71
1.035.915	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	10.405.789	1,05
721.300	StarPower Semiconductor Ltd Class A	34.329.996	3,46
1.032.900	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	16.690.378	1,68
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>88.330.793</b>	<b>8,90</b>
<b>Euro</b>			
145.597	ASM International NV	36.832.574	3,71
733.231	Cellnex Telecom SA	24.249.481	2,44
<b>Euro insgesamt</b>		<b>61.082.055</b>	<b>6,15</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
2.927.500	Koolearn Technology Holding Ltd	19.691.830	1,98
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>19.691.830</b>	<b>1,98</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
479.500	Advantest Corp	30.817.083	3,10
102.400	Hoya Corp	9.860.108	0,99
29.900	Lasertec Corp	4.927.625	0,50
328.900	Recruit Holdings Co Ltd	10.412.030	1,05
164.500	Sony Group Corp	12.510.952	1,26
838.109	Taiyo Yuden Co Ltd	24.327.996	2,45
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>92.855.794</b>	<b>9,35</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
223.300	MediaTek Inc	4.540.759	0,46
2.203.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	32.146.720	3,24
2.561.000	Unimicron Technology Corp	9.998.861	1,00
<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>		<b>46.686.340</b>	<b>4,70</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>			
127.546	SK Hynix Inc	7.609.911	0,77
<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>		<b>7.609.911</b>	<b>0,77</b>
<b>US-Dollar</b>			
574.150	Advanced Micro Devices Inc	37.187.695	3,74
194.808	Alphabet Inc Class C	17.285.314	1,74
205.802	Amazon.com Inc	17.287.368	1,74
107.803	Amdocs Ltd	9.799.293	0,99

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 95,96 % (31. Dezember 2021: 97,18 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
89.430	Analog Devices Inc	14.669.203	1,48
195.239	Arista Networks Inc	23.692.253	2,39
41.721	Assurant Inc	5.217.628	0,53
155.400	Bill.com Holdings Inc	16.932.384	1,70
157.290	Cadence Design Systems Inc	25.267.066	2,54
321.774	Ciena Corp	16.404.039	1,65
146.205	Coherent Corp	5.131.795	0,52
217.676	CrowdStrike Holdings Inc Class A	22.919.106	2,31
215.222	Datadog Inc Class A	15.818.817	1,59
143.504	Dexcom Inc	16.250.393	1,64
54.839	Enphase Energy Inc	14.530.141	1,46
268.983	Fortinet Inc	13.150.579	1,32
122.200	HubSpot Inc	35.331.686	3,56
228.606	Keysight Technologies Inc	39.107.628	3,94
981.361	Marvell Technology Inc	36.349.611	3,66
99.263	Micron Technology Inc	4.961.165	0,50
54.137	Microsoft Corp	12.983.135	1,31
83.567	Monolithic Power Systems Inc	29.550.127	2,98
53.633	Netflix Inc	15.815.299	1,59
7.568.359	Nokia OYJ ADR	35.117.186	3,54
254.770	Oracle Corp	20.824.900	2,10
41.878	QUALCOMM Inc	4.604.067	0,46
303.206	ROBLOX Corp Class A	8.629.243	0,87
93.937	ServiceNow Inc	36.472.919	3,67
128.803	Snowflake Inc Class A	18.488.383	1,86
231.485	T-Mobile US Inc	32.407.900	3,26
389.640	Uber Technologies Inc	9.635.797	0,97
359.442	Wolfspeed Inc	24.815.876	2,50
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>636.637.996</b>	<b>64,11</b>
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>952.894.719</b>	<b>95,96</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>952.894.719</b>	<b>95,96</b>

### Devisenterminkontrakte 1,22 % (31. Dezember 2021: 0,05 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
1.749.415 AUD	1.125.208 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	61.871	0,01
280.764 AUD	188.921 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.593	0,00
825.352 AUD	540.251 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	19.799	0,00
21.643.213 AUD	14.065.944 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	21	620.231	0,06
105.771 US\$	155.681 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	132	0,00

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,22 % (31. Dezember 2021: 0,05 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CNY</i>						
3.528.000 CNY	499.996 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	21	10.521	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
10.461.078 €	10.750.750 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	425.125	0,04
1.774.708 €	1.764.571 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	131.400	0,01
988.564 €	1.033.339 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	22.773	0,00
115.316.386 €	115.684.724 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	64	7.511.147	0,76
1.887 US\$	1.767 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
276.826 £	322.648 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	10.478	0,00
275.957 £	321.494 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	10.586	0,00
14.030.563 £	15.916.955 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	967.097	0,10
203.445 US\$	167.420 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.975	0,00
2.152.545 US\$	1.769.119 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	13	23.626	0,00
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
1.730.567 HKD	220.669 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	1.138	0,00
2.342.247 HKD	298.908 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	1.298	0,00
62.301.546 HKD	7.950.125 US\$	18.01.2023	UBS AG	6	35.056	0,00
3.140.231 HKD	400.742 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	20	1.738	0,00
152.051 US\$	1.182.819 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	449	0,00
160.375 US\$	1.248.895 HKD	18.01.2023	UBS AG	2	305	0,00
825.854 US\$	6.426.864 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	2.123	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
1.683.680 SGD	1.215.611 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	40.147	0,01
627.876 SGD	448.061 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	20.235	0,00
2.875.335 SGD	2.073.978 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	70.567	0,01
55.704.598 SGD	39.396.460 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	58	2.150.355	0,22
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b>					<b>12.141.765</b>	<b>1,22</b>
					<b>Zeitwert % des Nettovermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>965.036.484</b>	<b>97,18</b>

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,33 %) (31. Dezember 2021: (0,25 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
1.187.539 AUD	811.534 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(5.719)	(0,00)
155.649 AUD	106.001 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(384)	(0,00)
671.254 AUD	457.797 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(2.312)	(0,00)
2.376.807 US\$	3.590.717 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	9	(59.703)	(0,01)
1.076.754 US\$	1.649.898 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	6	(42.798)	(0,01)
151.616 US\$	233.517 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(6.839)	(0,00)
2.434.274 US\$	3.750.078 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	(110.373)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen CNY</i>						
62.545 CNY	9.059 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(9)	(0,00)
7.771 US\$	56.282 CNY	18.01.2023	UBS AG	2	(373)	(0,00)
162.933 US\$	1.154.240 CNY	18.01.2023	Westpac Banking Corp	23	(4.093)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
2.207.435 €	2.366.668 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(8.401)	(0,00)
898.227 €	960.229 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(626)	(0,00)
6.479.331 US\$	6.250.627 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(198.396)	(0,02)
3.567.449 US\$	3.377.825 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(41.181)	(0,00)
6.782.562 US\$	6.802.073 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	4	(484.291)	(0,05)
6.322.881 US\$	6.077.869 €	18.01.2023	UBS AG	5	(170.284)	(0,02)
25.513.359 US\$	25.091.802 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	70	(1.292.949)	(0,13)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
1.502.705 £	1.838.880 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	13	(30.560)	(0,00)
237.390 US\$	214.045 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(20.187)	(0,00)
593.554 US\$	503.507 £	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(12.356)	(0,00)
3.498.923 US\$	3.064.192 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	24	(188.456)	(0,02)
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
1.728.509 HKD	221.790 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(247)	(0,00)
1.978.532 HKD	254.152 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	(564)	(0,00)
2.930.983 HKD	376.604 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(940)	(0,00)
629.493 US\$	4.935.753 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(3.121)	(0,00)
83.171 US\$	652.187 HKD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(420)	(0,00)
432.178 US\$	3.385.326 HKD	18.01.2023	UBS AG	4	(1.719)	(0,00)
1.338.480 US\$	10.479.029 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	19	(4.617)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
1.041.454 SGD	778.105 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(1.345)	(0,00)
365.001 US\$	511.945 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(16.828)	(0,00)
363.107 US\$	515.927 SGD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(21.693)	(0,00)
1.625.190 US\$	2.274.174 SGD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(70.983)	(0,01)
2.373.587 US\$	3.363.997 SGD	18.01.2023	UBS AG	4	(135.423)	(0,01)
11.372.493 US\$	15.706.238 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	67	(341.869)	(0,04)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(3.280.059)</b>	<b>(0,33)</b>

## 5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(3.280.059)</b>	<b>(0,33)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>961.756.425</b>	<b>96,85</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>31.253.768</b>	<b>3,15</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>993.010.193</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	952.894.719	94,90
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	8.861.706	0,88
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>961.756.425</b>	<b>95,78</b>

## Absolute Return Multi Strategy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
12.622	Achillion Pharmaceuticals Inc <sup>*</sup>	6.311	0,00
1.356	Clementia Pharmaceuticals Inc <sup>*</sup>	0	0,00
3.641	Dova Pharmaceuticals Inc <sup>*</sup>	455	0,00
17.768	Fresh Market Escrow Inc <sup>*</sup>	0	0,00
1.250	Tobira Therapeutics Inc <sup>†</sup>	0	0,00
<b>Aktien insgesamt</b>		<b>6.766</b>	<b>0,00</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>6.766</b>	<b>0,00</b>
<b>Zusammenfassung</b>			
		<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>6.766</b>	<b>0,00</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>		<b>6.766</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>		<b>(6.766)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>0,00</b>	<b>00,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
		<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtver- mögens</b>
<sup>*</sup> Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind		6.766	6,77
<sup>†</sup> Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente		0	0,00
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>6.766</b>	<b>6,77</b>



## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 83,65 % (31. Dezember 2021: 87,03 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,45 %	24.01.2028	195.469	0,90
200.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy*	6,25 %	10.12.2024	195.400	0,90
200.000	Agile Group Holdings Ltd*	8,38 %	29.12.2049	50.557	0,23
200.000	AIA Group Ltd*	2,70 %	29.12.2049	173.625	0,80
200.000	AIA Group Ltd*	5,63 %	25.10.2027	204.154	0,94
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	3,40 %	06.12.2027	184.314	0,85
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00 %	06.12.2037	167.216	0,77
200.000	Axis Bank Ltd*	4,10 %	29.12.2049	173.894	0,80
200.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	167.565	0,77
200.000	Bangkok Bank PCL*	4,30 %	15.06.2027	192.764	0,89
200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	3,75 %	30.03.2026	186.009	0,86
200.000	BOC Aviation Ltd*	3,00 %	11.09.2029	173.517	0,80
200.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	10.10.2024	193.225	0,89
200.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd*	4,88 %	17.08.2026	191.519	0,89
200.000	CDBL Funding 2*	2,00 %	04.03.2026	181.938	0,84
200.000	Celestial Miles Ltd*	5,75 %	29.12.2049	192.000	0,89
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd*	4,75 %	08.02.2028	190.413	0,88
200.000	China Construction Bank Corp*	2,45 %	24.06.2030	187.677	0,87
200.000	China Construction Bank Corp*	4,25 %	27.02.2029	197.907	0,92
200.000	China Resources Land Ltd*	6,00 %	27.02.2024	200.563	0,93
200.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,13 %	03.06.2026	181.242	0,84
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95 %	20.10.2025	52.873	0,24
200.000	CK Hutchison International 21 Ltd*	2,50 %	15.04.2031	165.726	0,77
200.000	CLP Power HK Finance Ltd*	3,55 %	29.12.2049	185.638	0,86
300.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	272.669	1,26
200.000	Contemporary Ruiding Development Ltd*	2,63 %	17.09.2030	163.172	0,75
193.500	Continuum Energy Levanter Pte Ltd*	4,50 %	09.02.2027	173.915	0,80
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	4,80 %	06.08.2030	106.878	0,49
200.000	DBS Group Holdings Ltd*	1,82 %	10.03.2031	178.014	0,82
200.000	Dua Capital Ltd*	2,78 %	11.05.2031	158.765	0,73
200.000	Elect Global Investments Ltd*	4,10 %	29.12.2049	173.330	0,80
200.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	174.449	0,81
200.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	159.024	0,74
200.000	GC Treasury Center Co Ltd*	4,40 %	30.03.2032	177.677	0,82
200.000	GENM Capital Labuan Ltd*	3,88 %	19.04.2031	149.081	0,69
200.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	179.500	0,83
191.000	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	166.160	0,77
190.896	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	160.320	0,74
200.000	Hana Bank*	3,25 %	30.03.2027	186.574	0,86

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 83,65 % (31. Dezember 2021: 87,03 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	3,38 %	04.02.2032	166.322	0,77
200.000	HDFC Bank Ltd*	3,70 %	29.12.2049	172.100	0,80
200.000	HKT Capital No 6 Ltd*	3,00 %	18.01.2032	161.158	0,75
200.000	Horse Gallop Finance Ltd*	1,10 %	26.07.2024	187.756	0,87
250.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	237.204	1,10
200.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	2,25 %	02.11.2026	180.718	0,84
200.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	2,70 %	27.01.2027	183.919	0,85
200.000	Indian Railway Finance Corp Ltd*	2,80 %	10.02.2031	164.424	0,76
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,40 %	09.06.2031	166.548	0,77
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,54 %	27.04.2032	165.063	0,76
200.000	Inventive Global Investments Ltd*	1,50 %	15.07.2023	196.089	0,91
200.000	JD.com Inc*	3,38 %	14.01.2030	175.307	0,81
200.000	JMH Co Ltd*	2,50 %	09.04.2031	163.421	0,76
177.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13 %	18.05.2031	147.786	0,68
200.000	Kasikornbank PCL*	3,34 %	02.10.2031	176.253	0,81
200.000	Kookmin Bank*	2,50 %	04.11.2030	159.610	0,74
200.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40 %	29.12.2049	178.000	0,82
200.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	158.918	0,73
273.000	Lenovo Group Ltd*	5,83 %	27.01.2028	264.162	1,22
200.000	LG Chem Ltd*	2,38 %	07.07.2031	157.604	0,73
200.000	Link Finance Cayman 2009 Ltd*	2,75 %	19.01.2032	164.525	0,76
200.000	Longfor Group Holdings Ltd*	3,95 %	16.09.2029	147.000	0,68
200.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38 %	30.01.2027	181.118	0,84
200.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	154.422	0,71
200.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75 %	21.07.2028	167.544	0,77
300.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38 %	29.12.2049	288.750	1,34
200.000	MTR Corp Ltd*	1,63 %	19.08.2030	159.088	0,74
200.000	Network i2i Ltd*	5,65 %	29.12.2049	191.750	0,89
200.000	NWD MTN Ltd*	4,13 %	18.07.2029	163.749	0,76
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,60 %	15.06.2032	192.000	0,89
200.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	187.382	0,87
200.000	Pertamina Persero PT*	6,50 %	27.05.2041	204.119	0,94
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,25 %	24.10.2042	170.940	0,79
200.000	Philippine National Bank*	3,28 %	27.09.2024	188.998	0,87
200.000	Prudential Plc*	2,95 %	03.11.2033	164.048	0,76
200.000	REC Ltd*	2,25 %	01.09.2026	176.745	0,82
250.000	Reliance Industries Ltd*	2,88 %	12.01.2032	202.917	0,94
200.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries*	4,50 %	14.07.2028	168.073	0,78
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd*	5,20 %	12.01.2026	144.526	0,67
200.000	Sands China Ltd*	5,90 %	08.08.2028	187.533	0,87

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 83,65 % (31. Dezember 2021: 87,03 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
222.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	3,13 %	17.11.2031	185.893	0,86
200.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*	2,38 %	13.07.2030	167.037	0,77
200.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,38 %	13.04.2032	178.693	0,83
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	3,34 %	05.02.2030	183.336	0,85
200.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	192.634	0,89
200.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd*	2,25 %	24.11.2026	176.995	0,82
200.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*	2,70 %	13.01.2025	115.542	0,53
200.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,30 %	08.01.2031	168.382	0,78
400.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	3,10 %	08.01.2051	266.555	1,23
200.000	SK Battery America Inc*	2,13 %	26.01.2026	172.381	0,80
200.000	SK Hynix Inc*	2,38 %	19.01.2031	146.830	0,68
200.000	SK Telecom Co Ltd*	3,75 %	16.04.2023	199.227	0,92
162.160	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd*	6,75 %	24.04.2033	153.579	0,71
200.000	Studio City Finance Ltd*	6,00 %	15.07.2025	173.721	0,80
200.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	126.812	0,59
200.000	Tencent Holdings Ltd*	3,60 %	19.01.2028	183.654	0,85
200.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	124.502	0,58
200.000	TNB Global Ventures Capital Bhd*	4,85 %	01.11.2028	194.430	0,90
400.000	TSMC Arizona Corp*	2,50 %	25.10.2031	328.397	1,52
200.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00 %	14.10.2031	174.806	0,81
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*	3,98 %	09.11.2027	173.025	0,80
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	174.428	0,81
200.000	Woori Bank*	4,75 %	30.04.2024	196.888	0,91
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>18.090.069</b>	<b>83,65</b>
<b>Staatsanleihen 9,67 % (31. Dezember 2021: 10,39 %)</b>					
<b>Euro</b>					
758.000	Indonesia Government International Bond	1,40 %	30.10.2031	633.146	2,93
<b>Euro insgesamt</b>				<b>633.146</b>	<b>2,93</b>
<b>US-Dollar</b>					
200.000	Airport Authority	3,25 %	12.01.2052	141.774	0,66
200.000	Indonesia Government International Bond	5,25 %	17.01.2042	197.128	0,91
95.000	Indonesia Government International Bond	7,75 %	17.01.2038	114.475	0,53
350.000	Indonesia Government International Bond	8,50 %	12.10.2035	444.500	2,06
200.000	Korea Gas Corp	3,88 %	13.07.2027	189.426	0,88
200.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp	1,75 %	15.04.2026	177.314	0,82
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,75 %	18.04.2023	63.491	0,29

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 9,67 % (31. Dezember 2021: 10,39 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,88 %	21.02.2023	66.028	0,30
200.000	Sri Lanka Government International Bond	6,85 %	14.03.2024	63.704	0,29
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>1.457.840</b>	<b>6,74</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>2.090.986</b>	<b>9,67</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>20.181.055</b>	<b>93,32</b>

Devisenterminkontrakte 0,16 % (31. Dezember 2021: 0,09 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
51.264 CNY	7.381 US\$	17.01.2023	Goldman Sachs International	1	37	0,00
3.318.740.436 IDR	212.760 US\$	24.01.2023	Citibank NA	1	2.050	0,01
128.997.817 KRW	99.142 US\$	08.02.2023	BNP Paribas	1	3.443	0,02
161.877.830 KRW	117.948 US\$	08.02.2023	Goldman Sachs International	1	10.785	0,05
143.501.661 KRW	109.512 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	4.554	0,02
944.825 MYR	209.728 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	4.761	0,02
944.825 MYR	213.752 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	2.428	0,01
140.371 SGD	103.659 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.046	0,01
7.410.480 THB	209.078 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	4.882	0,02
7.410.480 THB	215.177 US\$	21.03.2023	Morgan Stanley	1	392	0,00
25.522 TWD	830 US\$	03.01.2023	BNP Paribas	1	1	0,00
25.522 TWD	829 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1	0,00
832 US\$	25.522 TWD	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	2	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>34.382</b>	<b>0,16</b>

Futures-Kontrakte 0,22 % (31. Dezember 2021: 0,11 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens	
(4)	Euro-Bund Future March 2023	31.591	0,15	
(18)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	15.379	0,07	
7	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	109	0,00	
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>			<b>47.079</b>	<b>0,22</b>

		Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>20.262.516</b>	<b>93,7</b>

## Asian Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2021: (0,06 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
3.318.740.436 IDR	214.575 US\$	05.01.2023	Citibank NA	1	(1.127)	(0,01)
3.824.858 THB	111.363 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(782)	(0,00)
25.522 TWD	836 US\$	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(4)	(0,00)
829 US\$	25.522 TWD	03.01.2023	BNP Paribas	1	(1)	(0,00)
199.931 US\$	6.436.538 TWD	30.01.2023	Citibank NA	1	(9.957)	(0,05)
212.762 US\$	3.318.740.436 IDR	05.01.2023	Citibank NA	1	(686)	(0,00)
542 US\$	18.667 THB	15.03.2023	Citibank NA	1	(1)	(0,00)
216.101 US\$	306.303.011 KRW	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(27.486)	(0,13)
213.520 US\$	944.825 MYR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(970)	(0,00)
213.095 US\$	7.410.480 THB	03.01.2023	Morgan Stanley	1	(864)	(0,00)
617.088 US\$	618.050 €	11.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(42.855)	(0,20)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(84.733)</b>	<b>(0,39)</b>

### Futures-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2021: (0,18 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
5	South Korea 3-Year Bond Future March 2023	(3.440)	(0,02)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(3.440)</b>	<b>(0,02)</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(88.173)</b>	<b>(0,41)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>20.174.343</b>	<b>93,29</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>1.451.866</b>	<b>6,71</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>21.626.209</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	19.654.105	90,16
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	526.950	2,42
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	43.639	0,20
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(50.351)	(0,23)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>20.174.343</b>	<b>92,55</b>

## China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert CNY	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 94,31 % (31. Dezember 2021: 97,10 %)</b>			
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
30.620	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	993.619	6,12
9.250	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class A	310.522	1,91
3.300	Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd Class A	263.340	1,62
2.700	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A	82.917	0,51
5.854	China Jushi Co Ltd Class A	80.258	0,49
10.600	China Merchants Bank Co Ltd Class A	394.956	2,43
9.700	China Yangtze Power Co Ltd Class A	203.700	1,25
700	Chongqing Brewery Co Ltd Class A	89.166	0,55
1.200	Contemporary Ampere Technology Co Ltd Class A	472.104	2,91
9.900	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A	347.193	2,14
4.433	Guangdong Haid Group Co Ltd Class A	273.649	1,69
6.000	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	469.200	2,89
1.920	Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A	127.565	0,79
4.668	Hundsun Technologies Inc Class A	188.867	1,16
10.600	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	328.600	2,02
22.600	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A	170.630	1,05
6.720	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd Class A	258.921	1,59
700	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	1.208.900	7,44
10.996	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	464.691	2,86
1.000	Luoyang Xinqianglian Slewing Bearing Co Ltd Class A	53.280	0,33
18.900	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	600.075	3,70
11.300	Midea Group Co Ltd Class A	585.340	3,60
12.100	Ming Yang Smart Energy Group Ltd Class A	305.646	1,88
3.768	Montage Technology Co Ltd Class A	235.877	1,45
13.304	NARI Technology Co Ltd Class A	324.618	2,00
13.700	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A	643.900	3,96
28.300	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	428.179	2,64
26.100	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	412.380	2,54
4.400	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	305.800	1,88
2.000	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A	631.940	3,89
8.000	Shenzhen Topband Co Ltd Class A	82.960	0,51
7.700	Sinoma Science & Technology Co Ltd Class A	165.011	1,02
700	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	78.260	0,48
17.900	TCL Technology Group Corp Class A	66.588	0,41
3.700	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A	139.342	0,86
6.700	Tongwei Co Ltd Class A	258.486	1,59
2.208	Tsingtao Brewery Co Ltd Class A	237.360	1,46
3.020	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	232.812	1,43
2.000	Wingtech Technology Co Ltd Class A	105.160	0,65
3.575	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	645.967	3,98

## China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert CNY	% des Nettovermögens
<b>Aktien 94,31 % (31. Dezember 2021: 97,10 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>			
7.700	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A	91.630	0,56
2.900	WuXi AppTec Co Ltd Class A	234.900	1,45
5.350	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	341.544	2,10
1.000	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	131.290	0,81
3.200	Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A	90.336	0,56
8.800	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A	187.792	1,16
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>14.345.271</b>	<b>88,32</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
2.400	Alibaba Group Holding Ltd	183.499	1,13
2.800	Meituan Class B	433.626	2,67
1.200	Tencent Holdings Ltd	355.297	2,19
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>972.422</b>	<b>5,99</b>
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>15.317.693</b>	<b>94,31</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>15.317.693</b>	<b>94,31</b>
		<b>Zeitwert CNY</b>	<b>% des Nettovermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>15.317.693</b>	<b>94,31</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>		<b>15.317.693</b>	<b>94,31</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>		<b>924.065</b>	<b>5,69</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>16.241.758</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>CNY</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind		15.317.693	92,68
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>15.317.693</b>	<b>92,68</b>

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert CNY	% des Netto- vermögens
<b>Einlagenzertifikat 20,52 % (31. Dezember 2021: 8,46 %)</b>					
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
20.000.000	Bank of Communications Co Ltd*	0,00 %	05.06.2023	19.767.170	4,36
20.000.000	China Citic Bank Corp*	0,00 %	22.09.2023	19.541.310	4,31
20.000.000	China Everbright Bank Co Ltd*	0,00 %	28.02.2023	19.507.820	4,31
30.000.000	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd*	2,44 %	14.02.2023	29.287.080	6,47
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>				<b>88.103.380</b>	<b>19,45</b>
<b>US-Dollar</b>					
700.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd*	5,00 %	16.11.2023	4.820.965	1,07
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>4.820.965</b>	<b>1,07</b>
<b>Einlagenzertifikat insgesamt</b>				<b>92.924.345</b>	<b>20,52</b>
<b>Unternehmensanleihen 60,07 % (31. Dezember 2021: 64,66 %)</b>					
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
10.000.000	Agricultural Bank of China Ltd**	4,30 %	11.04.2029	10.169.710	2,25
30.000.000	Bank of China Ltd**	4,84 %	11.10.2028	30.453.465	6,72
20.000.000	Bright Food Group Co Ltd*	3,25 %	12.07.2024	20.100.010	4,44
20.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	3,52 %	26.09.2024	20.240.050	4,47
10.000.000	China Post Group Co Ltd*	2,84 %	20.01.2025	9.969.220	2,20
10.000.000	China Resources Inc*	2,90 %	22.04.2025	9.975.070	2,20
20.000.000	GD Power Development Co Ltd*	3,33 %	06.07.2024	20.125.590	4,44
20.000.000	Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd*	3,00 %	21.04.2025	19.994.000	4,41
5.000.000	Henan Energy & Chemical Industry Group Co Ltd**	7,00 %	20.03.2023	1.293.798	0,29
5.000.000	Henan Energy & Chemical Industry Group Co Ltd**	7,20 %	06.03.2023	1.279.870	0,28
20.000.000	Shenzhen Metro Group Co Ltd**	3,25 %	12.07.2024	20.076.400	4,43
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>				<b>163.677.183</b>	<b>36,13</b>
<b>US-Dollar</b>					
2.000.000	BOC Aviation USA Corp*	1,63 %	29.04.2024	13.141.382	2,90
1.000.000	China Construction Bank Corp*	1,00 %	04.08.2023	6.766.981	1,49
1.870.000	China Hongqiao Group Ltd*	7,38 %	02.05.2023	12.810.161	2,83
1.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd*	3,00 %	18.07.2024	6.683.125	1,47
1.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd*	4,25 %	07.08.2023	6.877.371	1,52
500.000	Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd*	4,95 %	12.08.2024	2.968.360	0,66
2.000.000	Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd*	1,51 %	17.09.2025	12.456.006	2,75
1.435.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,38 %	19.07.2024	9.573.107	2,11
1.000.000	Kunlun Energy Co Ltd*	3,75 %	13.05.2025	6.702.292	1,48
1.000.000	Prosperous Ray Ltd*	4,63 %	12.11.2023	6.897.886	1,52
1.000.000	SF Holding Investment Ltd*	4,13 %	26.07.2023	6.871.075	1,52
1.000.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*	1,50 %	13.07.2025	6.322.575	1,39



## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert CNY	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 60,07 % (31. Dezember 2021: 64,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.000.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd*	1,00 %	23.09.2024	6.405.402	1,41
2.000.000	Unigroup International Holdings Ltd*	6,00 %	28.04.2023	4.012.933	0,89
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>108.488.656</b>	<b>23,94</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>272.165.839</b>	<b>60,07</b>
<b>Staatsanleihen 13,26 % (31. Dezember 2021: 20,53 %)</b>					
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
20.000.000	China Government Bond	2,18 %	25.08.2025	19.908.150	4,40
10.000.000	China Government Bond	2,47 %	02.09.2024	10.025.315	2,21
30.000.000	China Government Bond	2,69 %	12.08.2026	30.140.205	6,65
<b>Staatsanleihen insgesamt **</b>				<b>60.073.670</b>	<b>13,26</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>425.163.854</b>	<b>93,85</b>

Devisenterminkontrakte 0,87 % (31. Dezember 2021: 0,37 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn CNY	% des Netto- vermögens
9.388.414 CNY	1.350.000 US\$	30.01.2023	Citibank NA	1	68.042	0,02
10.734.151 CNY	1.500.000 US\$	12.01.2023	Goldman Sachs International	2	363.288	0,08
27.819.301 CNY	3.838.612 US\$	30.01.2023	Goldman Sachs International	4	1.317.603	0,29
52.918.740 CNY	7.454.215 US\$	12.01.2023	Standard Chartered Bank	1	1.380.983	0,31
20.633.493 CNY	2.900.000 US\$	30.01.2023	Standard Chartered Bank	3	611.952	0,13
4.995.428 CNY	700.000 US\$	30.01.2023	UBS AG	1	162.642	0,04
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
1.530.864 CNY	220.000 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	17.047	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>3.921.557</b>	<b>0,87</b>

	Zeitwert CNY	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>429.085.411</b>	<b>94,72</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Futures-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2021: (0,07 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust CNY	% des Netto- vermögens
50	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(37.837)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>±</sup></b>		<b>(37.837)</b>	<b>(0,01)</b>

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,60 %) (31. Dezember 2021: (0,48 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust CNY	% des Nettovermögens
1.204.215 US\$	8.482.613 CNY	12.01.2023	Citibank NA	1	(156.782)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
2.552 CNY	365 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(144)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
19.721 £	167.103 CNY	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(3.583)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
47.092.321 US\$	326.558.312 CNY	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(2.516.686)	(0,56)
571.635 US\$	3.958.061 CNY	15.03.2023	UBS AG	1	(24.648)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(2.701.843)</b>	<b>(0,60)</b>
					<b>Zeitwert CNY</b>	<b>% des Nettovermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(2.739.680)</b>	<b>(0,61)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>426.345.731</b>	<b>94,11</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>26.697.848</b>	<b>5,89</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>453.043.579</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>					<b>CNY</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind					281.576.891	54,48
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden					143.586.963	27,78
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden					(37.837)	(0,01)
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente					1.219.714	0,24
<b>Anlagen insgesamt</b>					<b>426.345.731</b>	<b>82,49</b>

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 96,67 % (31. Dezember 2021: 95,09 %)</b>			
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
66.000	Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A	2.523.012	0,79
4.416.072	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	19.786.270	6,23
3.533.007	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A	6.658.681	2,10
1.546.054	JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A	6.538.303	2,06
3.000.055	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	13.766.991	4,34
1.656.031	Midea Group Co Ltd Class A	12.398.362	3,91
221.014	Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A	3.726.558	1,17
5.614.037	Satellite Chemical Co Ltd Class A	12.576.884	3,96
45.900	SG Micro Corp Class A	1.145.037	0,36
1.250.058	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A	5.989.351	1,89
550.027	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	5.525.033	1,74
739.035	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	2.796.409	0,88
1.516.059	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	20.301.476	6,40
655.004	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	12.429.157	3,91
5.000.103	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	3.931.370	1,24
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>130.092.894</b>	<b>40,98</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
2.319.000	Akeso Inc Class B	12.776.123	4,03
1.500.000	Alibaba Group Holding Ltd	16.576.019	5,22
2.490.500	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	13.928.382	4,39
6.698.000	China National Building Material Co Ltd - H Shares	5.500.891	1,73
5.079.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	11.309.876	3,56
2.000.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	13.978.308	4,40
2.538.000	China Resources Land Ltd	11.625.122	3,66
7.278.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	5.408.414	1,70
8.750.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	9.192.884	2,90
5.299.000	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares	18.059.488	5,69
350.000	JD.com Inc Class A	9.874.503	3,11
375.000	Li Ning Co Ltd	3.255.146	1,03
5.299.600	Man Wah Holdings Ltd	5.275.869	1,66
218.000	Meituan Class B	4.879.544	1,54
1.271.000	SITC International Holdings Co Ltd	2.826.996	0,89
450.000	Tencent Holdings Ltd	19.257.010	6,07
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>163.724.575</b>	<b>51,58</b>
<b>US-Dollar</b>			
485.010	ZTO Express Cayman Inc ADR	13.032.219	4,11
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>13.032.219</b>	<b>4,11</b>

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
	<b>Aktien 96,67 % (31. Dezember 2021: 95,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien insgesamt *</b>	<b>306.849.688</b>	<b>96,67</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>306.849.688</b>	<b>96,67</b>

Devisenterminkontrakte 0,35 % (31. Dezember 2021: 0,04 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
21.718 CHF	23.139 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	372	0,00
59.105 CHF	63.248 US\$	18.01.2023	UBS AG	8	738	0,00
400.161 CHF	410.245 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	11	22.957	0,01
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
284.081 €	293.068 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	10.424	0,00
25.157 €	26.871 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	5	0,00
9.567.850 €	9.541.827 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	24	679.788	0,22
2 US\$	2 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
6.209 £	6.992 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	479	0,00
10.580 £	12.105 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	626	0,00
217 US\$	180 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1	0,00
1.079 US\$	885 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	14	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
251.708 SGD	182.089 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	5.646	0,00
109.131 SGD	79.342 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	2.052	0,00
8.986.347 SGD	6.325.634 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	19	376.759	0,12
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b>					<b>1.099.861</b>	<b>0,35</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>307.949.549</b>	<b>97,02</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2021: (0,05 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
1.952 CHF	2.121 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(8)	(0,00)
5.546 CHF	6.022 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(18)	(0,00)
3.238 CHF	3.514 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(8)	(0,00)
2.686 US\$	2.518 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(40)	(0,00)

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2021: (0,05 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF (Fortsetzung)</i>						
8.384 US\$	7.937 CHF	18.01.2023	UBS AG	2	(208)	(0,00)
127.010 US\$	123.184 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	21	(6.346)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
43.101 €	46.210 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(164)	(0,00)
15.180 €	16.228 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(11)	(0,00)
381.231 US\$	376.133 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	9	(20.603)	(0,01)
214.082 US\$	211.227 €	18.01.2023	UBS AG	3	(11.578)	(0,01)
6.542.257 US\$	6.570.461 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	32	(477.161)	(0,15)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
1.766 £	2.160 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	(35)	(0,00)
103 US\$	93 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(9)	(0,00)
4.296 US\$	3.743 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	(207)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
34.267 SGD	25.602 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(44)	(0,00)
203.166 US\$	286.439 SGD	18.01.2023	UBS AG	7	(10.473)	(0,00)
4.854.729 US\$	6.898.956 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	27	(290.799)	(0,09)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(817.712)</b>	<b>(0,26)</b>
					<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto-</b>
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(817.712)</b>	<b>(0,26)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>307.131.837</b>	<b>96,76</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>10.281.839</b>	<b>3,24</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>317.413.676</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>					<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind					306.849.688	96,29
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente					282.149	0,09
<b>Anlagen insgesamt</b>					<b>307.131.837</b>	<b>96,38</b>

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 81,77 % (31. Dezember 2021: 88,95 %)</b>					
<b>Euro</b>					
1.000.000	Ares European CLO X DAC Series 10X Class F	8,45 %	15.10.2031	806.436	0,58
2.400.000	Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F	11,41 %	15.04.2035	1.986.135	1,44
1.000.000	BlackRock European CLO X DAC Series 10X Class FR	11,13 %	15.10.2034	827.207	0,60
1.500.000	CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class F	10,90 %	25.04.2036	1.254.004	0,91
1.000.000	Harvest CLO XXVII DAC Series 27X Class F	11,14 %	15.07.2034	827.486	0,60
1.150.000	Otranto Park CLO DAC Series 1X Class F	10,85 %	15.05.2035	941.821	0,68
1.000.000	Palmer Square European CLO 2021-2 DAC Series 2022-1X Class F	10,31 %	21.01.2035	809.486	0,59
1.600.000	Providus CLO IV DAC Series 4X Class ER	7,45 %	20.04.2034	1.427.448	1,03
1.300.000	Voya Euro CLO IV DAC Series 4X Class FR	11,04 %	15.10.2034	1.061.087	0,77
<b>Euro insgesamt</b>				<b>9.941.110</b>	<b>7,20</b>
<b>US-Dollar</b>					
2.000.000	AB BSL CLO 1 Ltd Series 2020-1X Class ER	11,49 %	15.01.2035	1.734.112	1,26
1.000.000	AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3A Class E	11,19 %	20.10.2034	870.166	0,63
1.000.000	AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E	11,76 %	20.10.2034	870.166	0,63
2.800.000	AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E	12,64 %	20.10.2035	2.711.886	1,96
1.500.000	Aimco CLO Series 2017-A Series 2017-AX Class FR	13,35 %	20.04.2034	1.251.855	0,91
2.000.000	Apidos CLO XX Series 2015-20X Class DR	10,49 %	16.07.2031	1.713.681	1,24
2.100.000	Apidos CLO XXIV Series 2016-24X Class DR	10,61 %	20.10.2030	1.767.141	1,28
3.000.000	Apidos CLO XXXIV Series 2020-34X Class ER	11,31 %	20.01.2035	2.737.344	1,98
1.000.000	Ares XLIX CLO Ltd Series 2018-49X Class E	10,02 %	22.07.2030	834.745	0,61
4.000.000	Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR	10,94 %	15.10.2030	3.255.794	2,36
4.000.000	Assurant CLO I Ltd Series 2018-2X Class E	10,96 %	20.10.2031	3.207.949	2,32
2.825.000	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class D	10,61 %	20.04.2031	2.326.277	1,69
2.000.000	Burnham Park CLO Ltd Series 2016-1X Class ER	10,21 %	20.10.2029	1.609.050	1,17
5.000.000	Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D	9,96 %	15.05.2031	3.861.976	2,80
2.000.000	Chenango Park CLO Ltd Series 2018-1X Class D	10,59 %	15.04.2030	1.610.412	1,17
6.000.000	Cific Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E	9,79 %	18.04.2031	4.987.100	3,61
3.000.000	Dryden 49 Senior Loan Fund Series 2017-49X Class E	11,09 %	18.07.2030	2.550.577	1,85
5.000.000	Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E	10,39 %	15.07.2031	4.422.531	3,20
2.135.000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund Series 2013-28X Class B2LR	11,06 %	15.08.2030	1.878.495	1,36
1.250.000	Eaton Vance CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class ER	10,41 %	20.01.2030	1.004.913	0,73
2.000.000	Eaton Vance CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E	10,79 %	15.10.2030	1.633.913	1,18
1.050.000	Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R	10,85 %	24.07.2030	874.219	0,63
4.000.000	Galaxy XXV CLO Ltd Series 2018-25X Class E	10,31 %	25.10.2031	3.433.422	2,49
4.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 14 Ltd Series 2022-14X Class E	12,37 %	20.07.2035	4.165.937	3,02
1.588.000	Goldentree Loan Management US CLO 4 Ltd Series 2019-4X Class F	10,72 %	24.04.2031	1.230.117	0,89
1.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd Series 2019-5X Class F	11,38 %	20.10.2032	1.091.188	0,79
3.000.000	Invesco CLO 2022-1 Ltd Series 2022-1X Class D	7,69 %	20.04.2035	2.751.839	1,99
750.000	KKR CLO 17 Ltd Series 17X Class E	12,18 %	15.04.2034	649.611	0,47

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 81,77 % (31. Dezember 2021: 88,95 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.000.000	Long Point Park CLO Ltd Series 2017-1X Class D2	10,39 %	17.01.2030	782.731	0,57
3.702.500	Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E	9,74 %	15.04.2029	3.354.323	2,43
3.300.000	Magnetite CLO Ltd Series 2015-14RX Class E	10,39 %	18.10.2031	2.944.434	2,13
1.650.000	Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2	11,29 %	15.01.2028	1.396.763	1,01
2.650.000	Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2	12,23 %	15.04.2031	2.242.127	1,62
2.490.000	Magnetite XVII Ltd Series 2016-18X Class FR	12,21 %	15.11.2028	2.099.817	1,52
2.000.000	Mariner CLO 5 Ltd Series 2018-5X Class E	10,01 %	25.04.2031	1.651.294	1,20
6.385.000	Octagon Investment Partners XV Ltd Series 2013-1X Class ER	11,80 %	19.07.2030	5.675.618	4,11
500.000	Octagon Loan Funding Ltd Series 2014-1X Class ERR	10,67 %	18.11.2031	386.188	0,28
4.000.000	Oha Loan Funding 2013-1 Ltd Series 2013-1X Class ER2	9,82 %	23.07.2031	3.572.082	2,59
2.500.000	Palmer Square CLO Ltd Series 2020-3X Class ER	12,52 %	15.11.2031	2.095.627	1,52
2.000.000	Post CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E	10,66 %	16.04.2031	1.762.827	1,28
2.000.000	PPM CLO 3 Ltd Series 2019-3X Class E	11,40 %	17.04.2034	1.655.252	1,20
4.000.000	Trestles CLO II Ltd Series 2018-2X Class D	10,11 %	25.07.2031	3.356.070	2,43
1.000.000	Trestles CLO Ltd Series 2021-18X Class E	11,86 %	20.01.2035	902.946	0,65
2.000.000	Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class ER	11,46 %	25.01.2035	1.815.103	1,32
1.675.000	Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class ER	11,15 %	15.01.2035	1.354.454	0,98
2.000.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class E	11,76 %	25.04.2033	1.806.310	1,31
1.000.000	Trinitas CLO XVII Ltd Series 2021-17X Class E	11,84 %	20.10.2034	894.145	0,65
2.500.000	Voya CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class DR	10,44 %	18.01.2029	2.145.316	1,55
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>102.929.843</b>	<b>74,57</b>
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>112.870.953</b>	<b>81,77</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>112.870.953</b>	<b>81,77</b>

Devisenterminkontrakte 2,37 % (31. Dezember 2021: 0,04 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
314.108 €	320.699 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	14.872	0,01
251.127 €	261.645 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	6.642	0,01
24.364.974 €	24.857.422 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	10	1.172.393	0,85
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
12.427.556 £	13.986.605 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	968.426	0,70
13.372.565 £	15.125.660 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	966.573	0,70
159.793 US\$	131.164 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	1.953	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
222.818 SEK	20.054 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.349	0,00
28.053.000 SEK	2.560.628 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	134.043	0,10
676.276 SEK	63.872 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	1.089	0,00
16.798 US\$	174.031 SEK	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	81	0,00

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,37 % (31. Dezember 2021: 0,04 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>3.267.421</b>	<b>2,37</b>
					<b>Zeitwert US\$</b>	<b>% des Nettovermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>116.138.374</b>	<b>84,14</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,72 %) (31. Dezember 2021: (0,47 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
9.481.414 US\$	9.586.579 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(760.209)	(0,55)
854.159 US\$	800.000 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(504)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
768.743 US\$	755.396 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	(38.269)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
283.737 £	346.328 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(4.885)	(0,01)
4.295.499 US\$	3.722.510 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(184.082)	(0,13)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
204.138 SEK	19.844 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(235)	(0,00)
370.670 SEK	35.882 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(277)	(0,00)
18.916 US\$	211.343 SEK	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(1.385)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(989.846)</b>	<b>(0,72)</b>

### Total Return Swap-Kontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens	
US\$ 13.500.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup>	(334.323)	(0,24)	
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(334.323)</b>	<b>(0,24)</b>

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

<sup>2</sup> Kontrahent für diese Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.324.169)</b>	<b>(0,96)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>114.814.205</b>	<b>83,18</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>23.223.259</b>	<b>16,82</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>138.037.464</b>	<b>100,00</b>



## CLO Income – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	112.870.953	80,86
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.943.252	1,39
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>114.814.205</b>	<b>82,25</b>

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Schatzwechsel 45,88 %</b>					
<b>US-Dollar</b>					
100.000	United States Treasury Bill	0,00 %	19.01.2023	99.840	0,12
100.000	United States Treasury Bill	0,00 %	02.02.2023	99.683	0,12
7.300.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.02.2023	7.270.914	8,45
100.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.02.2023	99.503	0,11
7.300.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.02.2023	7.256.119	8,44
10.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.03.2023	9.907.035	11,52
15.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	01.06.2023	14.720.780	17,12
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>39.453.874</b>	<b>45,88</b>
<b>Agency Bonds 12,25 %</b>					
<b>US-Dollar</b>					
4.125.000	Federal Home Loan Banks	0,13 %	28.08.2023	4.001.234	4,65
6.725.000	Federal Home Loan Mortgage Corp	0,25 %	24.08.2023	6.529.602	7,60
<b>Agency Bonds insgesamt **</b>				<b>10.530.836</b>	<b>12,25</b>
<b>Unternehmensanleihen 30,49 %</b>					
<b>US-Dollar</b>					
540.000	American Express Co**	4,30 %	03.11.2023	537.493	0,63
1.000.000	American Express Co**	5,18 %	04.03.2025	999.689	1,16
1.400.000	Analog Devices Inc**	4,57 %	01.10.2024	1.381.666	1,61
1.390.000	AT&T Inc**	4,96 %	25.03.2024	1.383.792	1,61
855.000	Bank of America Corp**	5,07 %	25.04.2025	850.300	0,99
20.000	Bank of New York Mellon Corp**	4,12 %	25.10.2024	19.761	0,02
345.000	Capital One Financial Corp**	5,13 %	30.01.2023	345.000	0,40
330.000	Capital One Financial Corp**	5,48 %	09.05.2025	326.125	0,38
525.000	Caterpillar Financial Services Corp**	4,56 %	13.09.2024	521.635	0,61
235.000	Cisco Systems Inc**	2,60 %	28.02.2023	234.274	0,27
40.000	Enbridge Inc**	4,78 %	16.02.2024	39.798	0,05
90.000	Florida Power & Light Co**	4,37 %	10.05.2023	89.854	0,10
565.000	General Electric Co**	5,08 %	15.04.2023	565.094	0,66
345.000	General Electric Co**	5,77 %	15.03.2023	345.037	0,40
815.000	General Motors Financial Co Inc*	3,25 %	05.01.2023	814.952	0,95
1.610.000	Goldman Sachs Group Inc**	6,33 %	29.11.2023	1.622.519	1,89
1.195.000	John Deere Capital Corp**	3,78 %	10.07.2023	1.193.093	1,39
10.000	John Deere Capital Corp**	4,80 %	07.03.2025	9.926	0,01
270.000	John Deere Capital Corp**	5,27 %	07.06.2023	270.132	0,31
1.673.000	JPMorgan Chase & Co**	4,90 %	23.06.2025	1.645.094	1,91
1.620.000	Morgan Stanley**	4,58 %	24.01.2025	1.597.953	1,86
364.000	Royal Bank of Canada**	4,32 %	21.01.2025	357.667	0,42
887.000	Royal Bank of Canada**	4,44 %	17.01.2023	886.877	1,03

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 30,49 % (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.104.000	Simon Property Group LP**	4,16 %	11.01.2024	1.093.896	1,27
730.000	Starbucks Corp**	4,55 %	14.02.2024	725.956	0,84
90.000	Thermo Fisher Scientific Inc**	4,16 %	18.04.2023	89.802	0,10
1.200.000	Thermo Fisher Scientific Inc**	4,20 %	18.10.2023	1.195.842	1,39
310.000	TotalEnergies Capital International SA*	2,70 %	25.01.2023	309.616	0,36
1.185.000	Toyota Motor Credit Corp**	4,94 %	22.03.2024	1.184.830	1,38
1.240.000	Truist Bank**	4,00 %	17.01.2024	1.232.036	1,43
240.000	Truist Financial Corp**	4,68 %	09.06.2025	235.067	0,27
1.395.000	Verizon Communications Inc**	4,82 %	22.03.2024	1.384.556	1,61
1.885.000	Wells Fargo & Co*	3,75 %	24.01.2024	1.860.178	2,16
875.000	Zoetis Inc*	3,25 %	01.02.2023	873.752	1,02
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>26.223.262</b>	<b>30,49</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>76.207.972</b>	<b>88,62</b>

### Devisenterminkontrakte (1,77 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
17.336.877 £	19.555.606 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	4	1.307.188	1,52
495.924 £	573.318 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	23.465	0,03
2.715.953 £	3.096.165 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	44	172.155	0,20
456.961 US\$	375.124 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	5.546	0,01
953.280 US\$	782.913 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	11.142	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>1.519.496</b>	<b>1,77</b>

### Total Return Swap-Kontrakte 0,00 %

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
USD 84.163.608	31.03.2023	0,00 <sup>1</sup>	Goldman Sachs Commodity Strategy 1168 Index <sup>2</sup>	0	0,00
USD 590.000	31.03.2023	0,00 <sup>1</sup>	Goldman Sachs Commodity Strategy 1168 Index <sup>2</sup>	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>0</b>	<b>0,00</b>

<sup>1</sup> Fester Zinssatz.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>77.727.468</b>	<b>90,39</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (0,39 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
340.394 £	418.067 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(8.445)	(0,01)
120.900 £	145.915 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(426)	(0,00)
1.459.845 £	1.784.266 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	31	(27.523)	(0,03)
318.170 US\$	273.934 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(11.476)	(0,01)
855.636 US\$	773.145 £	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(74.749)	(0,09)
4.607.128 US\$	4.003.361 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	33	(210.427)	(0,25)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(333.046)</b>	<b>(0,39)</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(333.046)</b>	<b>(0,39)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>77.394.422</b>	<b>90,00</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>8.603.007</b>	<b>10,00</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>85.997.429</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	3.858.498	4,20
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	72.349.474	78,72
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.186.450	1,29
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>77.394.422</b>	<b>84,21</b>

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 91,91 % (31. Dezember 2021: 91,54 %)</b>					
<b>Euro</b>					
200.000	Arkema SA*	1,50 %	29.12.2049	169.492	0,01
17.500.000	Aroundtown SA*	2,88 %	29.12.2049	7.144.462	0,40
38.804.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	31.957.034	1,79
86.500.000	Bayer AG*	2,38 %	12.11.2079	77.856.488	4,37
51.500.000	Bayer AG*	3,13 %	12.11.2079	43.853.743	2,46
7.600.000	Bayer AG*	5,38 %	25.03.2082	6.688.000	0,38
13.000.000	Bertelsmann SE & Co KGaA*	3,50 %	23.04.2075	11.882.806	0,67
4.090.000	BP Capital Markets Plc*	3,25 %	29.12.2049	3.774.182	0,21
62.580.000	BP Capital Markets Plc*	3,63 %	29.12.2049	53.895.586	3,02
27.300.000	EDP - Energias de Portugal SA*	1,88 %	14.03.2082	19.772.025	1,11
15.800.000	Electricite de France SA*	7,50 %	29.12.2049	15.780.092	0,89
16.800.000	Elia Group SA*	2,75 %	29.12.2049	16.437.154	0,92
33.600.000	ELM BV for Firmenich International SA*	3,75 %	29.12.2049	32.067.000	1,80
40.600.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,38 %	31.08.2081	30.170.577	1,69
2.900.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,63 %	05.08.2079	2.334.062	0,13
42.700.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,88 %	29.06.2080	36.820.409	2,07
13.200.000	Engie SA*	1,63 %	29.12.2049	12.127.500	0,68
10.094.000	Eni SpA*	2,00 %	29.12.2049	8.427.204	0,47
4.209.000	Eni SpA*	3,38 %	29.12.2049	3.506.013	0,20
42.700.000	Evonik Industries AG*	1,38 %	02.09.2081	34.947.815	1,96
20.000.000	Iberdrola International BV*	1,45 %	29.12.2049	17.035.800	0,96
32.166.000	Koninklijke FrieslandCampina NV*	2,85 %	29.12.2049	27.450.786	1,54
7.100.000	NGG Finance Plc*	2,13 %	05.09.2082	5.910.168	0,33
17.700.000	Orsted A/S*	5,25 %	08.12.3022	18.031.875	1,01
50.200.000	Solvay SA*	2,50 %	29.12.2049	44.438.546	2,49
112.035.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	87.946.915	4,93
25.053.000	SSE Plc*	3,13 %	29.12.2049	22.744.441	1,28
33.405.000	SSE Plc*	4,00 %	29.12.2049	30.541.690	1,71
34.310.000	TenneT Holding BV*	2,37 %	29.12.2049	31.682.540	1,78
28.200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale*	2,38 %	29.12.2049	23.688.790	1,33
25.944.000	TotalEnergies SE*	1,63 %	29.12.2049	21.153.830	1,19
13.705.000	TotalEnergies SE*	1,75 %	29.12.2049	12.965.761	0,73
12.045.000	TotalEnergies SE*	2,63 %	29.12.2049	11.318.578	0,64
5.000.000	TotalEnergies SE*	3,37 %	29.12.2049	4.687.280	0,26
31.500.000	Veolia Environnement SA*	2,00 %	29.12.2049	25.854.413	1,45
69.000.000	Veolia Environnement SA*	2,25 %	29.12.2049	61.716.636	3,46
44.400.000	Veolia Environnement SA*	2,50 %	29.12.2049	35.516.892	1,99
17.100.000	Volkswagen International Finance NV*	3,50 %	29.12.2049	15.866.748	0,89
53.700.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88 %	29.12.2049	47.721.472	2,68

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 91,91 % (31. Dezember 2021: 91,54 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
28.900.000	Volkswagen International Finance NV REG S*	3,88 %	29.12.2049	24.059.366	1,35
15.000.000	Volkswagen International Finance NV*	4,38 %	29.12.2049	12.290.400	0,69
30.600.000	Volkswagen International Finance NV*	4,63 %	29.12.2049	27.203.798	1,53
<b>Euro insgesamt</b>				<b>1.059.438.369</b>	<b>59,45</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
25.593.000	BP Capital Markets Plc*	4,25 %	29.12.2049	25.531.340	1,43
62.536.000	Centrica Plc*	5,25 %	10.04.2075	64.939.245	3,64
20.800.000	Electricite de France SA*	5,88 %	29.12.2049	19.389.839	1,09
90.700.000	Electricite de France SA*	6,00 %	29.12.2049	92.119.857	5,17
113.587.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	121.366.913	6,81
3.500.000	Orsted A/S*	2,50 %	18.02.3021	2.732.524	0,15
28.484.000	SSE Plc*	3,74 %	29.12.2049	29.335.379	1,65
3.000.000	Vodafone Group Plc*	4,88 %	03.10.2078	3.175.703	0,18
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>358.590.800</b>	<b>20,12</b>
<b>US-Dollar</b>					
75.750.000	AT Securities BV*	5,25 %	29.12.2049	33.716.824	1,89
12.018.000	CMS Energy Corp**	3,75 %	01.12.2050	8.508.209	0,48
71.590.000	Enbridge Inc**	5,50 %	15.07.2077	59.409.680	3,33
1.980.000	Enbridge Inc**	6,00 %	15.01.2077	1.706.206	0,10
24.500.000	Paramount Global**	6,38 %	30.03.2062	18.800.649	1,05
30.955.000	Rogers Communications Inc**	5,25 %	15.03.2082	25.633.190	1,44
4.919.000	Transcanada Trust**	5,30 %	15.03.2077	3.894.640	0,22
75.890.000	Vodafone Group Plc*	6,25 %	03.10.2078	68.302.778	3,83
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>219.972.176</b>	<b>12,34</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>1.638.001.345</b>	<b>91,91</b>
<b>Anzahl der Anteile</b>	<b>Wertpapierbezeichnung</b>			<b>Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
<b>Investmentfonds 0,58 % (31. Dezember 2021: 0,46 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
1.300.000	Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund			10.317.170	0,58
<b>Investmentfonds insgesamt <sup>h</sup></b>				<b>10.317.170</b>	<b>0,58</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>1.648.318.515</b>	<b>92,49</b>

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,05 % (31. Dezember 2021: 0,56 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
2.708.195 €	2.676.114 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	203.245	0,01
20.831.638 €	18.028.698 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	523.950	0,03
384.696.132 €	338.717.003 £	18.01.2023	UBS AG	2	3.162.252	0,18
4.896.919 €	4.949.547 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	263.943	0,01
374.436.456 €	369.934.722 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	28.162.625	1,58
14.718.064 €	12.803.797 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	295.752	0,02
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
54.702 €	85.252 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	553	0,00
311.474 €	486.586 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	2.416	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
331.483 CHF	335.600 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	301	0,00
355.097 €	345.893 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	4.593	0,00
5.638.958 €	5.471.537 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	22	94.482	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
1.435.974 €	1.263.370 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	12.902	0,00
68.100.402 €	59.575.188 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	74	994.381	0,06
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
6.331 €	9.066 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2	0,00
33.115 €	46.623 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	564	0,00
8.335 SGD	5.814 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	5	0,00
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
3.494.340 €	3.520.119 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	199.367	0,01
1.518.536 €	1.489.807 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	124.017	0,01
36.639.522 €	36.508.359 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	61	2.466.223	0,14
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>36.511.573</b>	<b>2,05</b>
					<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto-</b>
					<b>EUR</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>1.684.830.088</b>	<b>94,54</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte (2,10 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Kapitalbetrag EUR	Beschreibung	Zinsaufwand/ (Zinseinnahmen)	Fälligkeitsdatum*	Zeitwert EUR	Vertragliche Restlaufzeit der Vereinbarung*	% des Nettovermögens
10.668.732	Citigroup Reverse Repurchase Agreement, collateralised by Southern Co, 1.88%, maturing on 15/08/2081	0,25 %	Open/Demand	(10.668.732)	Overnight and Continuous	(0,60)
15.315.288	Citigroup Reverse Repurchase Agreement, collateralised by BP Capital Markets Plc, 3.63%, maturing on 29/12/2049	0,35 %	Open/Demand	(15.315.288)	Overnight and Continuous	(0,86)

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte (2,17 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %)) (Fortsetzung)

Kapital- betrag EUR	Beschreibung	Zinsaufwand/ (Zinsein- nahmen)	Fälligkeitsdatum*	Zeitwert EUR	Vertragliche Restlaufzeit der Vereinbarung*	% des Nettover- mögens
11.461.555	Citigroup Reverse Repurchase Agreement, collateralised by Volkswagen International Finance NV, 3.88%, maturing on 29/12/2049	0,35 %	Open/Demand	(11.461.555)	Overnight and Continuous	(0,64)
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>∞</sup></b>				<b>(37.445.575)</b>		<b>(2,10)</b>

\* Offene umgekehrte Pensionsgeschäfte ohne ein bestimmtes Fälligkeitsdatum. Jede Partei kann die Vereinbarung auf Verlangen kündigen.

### Devisenterminkontrakte (1,14 %) (31. Dezember 2021: (0,64 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
2.696.281 €	2.882.750 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(2.089)	(0,00)
2.430.690 £	2.768.989 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(31.038)	(0,00)
22.477.139 £	25.526.684 €	18.01.2023	UBS AG	1	(208.233)	(0,01)
14.180.145 US\$	13.670.631 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(397.443)	(0,02)
6.771.235 US\$	6.685.312 €	18.01.2023	UBS AG	2	(347.163)	(0,02)
23.616.942 US\$	23.262.888 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	(1.156.477)	(0,07)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
86.959 AUD	56.153 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(920)	(0,00)
5.344.758 AUD	3.481.555 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	(86.789)	(0,01)
19.973 €	31.653 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(131)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
636.153 CHF	650.445 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(5.812)	(0,00)
29.874.528 CHF	30.788.041 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	22	(515.274)	(0,03)
527.673 €	522.205 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(1.492)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
920.638 €	817.449 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(144)	(0,00)
2.580.110 £	2.973.012 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(66.752)	(0,00)
88.286.793 £	100.141.357 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	53	(694.321)	(0,04)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
6.417 €	9.214 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(15)	(0,00)
26.686 SGD	18.701 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(71)	(0,00)
1.446.101 SGD	1.021.847 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	12	(12.268)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
6.472.980 US\$	6.330.595 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(271.626)	(0,02)
3.929.981 US\$	3.809.970 €	18.01.2023	UBS AG	3	(131.350)	(0,01)
235.539.697 US\$	236.768.592 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	44	(16.293.926)	(0,91)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(20.223.334)</b>	<b>(1,14)</b>



## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(57.668.909)</b>	<b>(3,24)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>1.627.161.179</b>	<b>91,30</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>154.993.629</b>	<b>8,70</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>1.782.154.808</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>	EUR	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	1.520.048.771	82,42
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	117.952.574	6,40
μ Investmentfonds	10.317.170	0,56
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(21.157.336)	(1,15)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>1.627.161.179</b>	<b>88,23</b>

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 31,50 % (31. Dezember 2021: 32,17 %)</b>					
<b>Euro</b>					
700.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	2,75 %	22.01.2033	568.649	0,02
6.921.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13 %	19.07.2024	1.323.096	0,06
16.529.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	1,88 %	05.11.2031	12.770.309	0,51
<b>Euro insgesamt</b>				<b>14.662.054</b>	<b>0,59</b>
<b>US-Dollar</b>					
33.400.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40 %	09.03.2023	32.701.186	1,31
2.072.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	3,65 %	02.11.2029	1.944.481	0,08
22.127.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60 %	02.11.2047	20.399.124	0,82
4.527.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC*	2,50 %	06.05.2031	3.773.879	0,15
7.530.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95 %	12.02.2030	5.768.352	0,23
5.620.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**	5,13 %	11.08.2061	4.618.836	0,18
3.195.000	African Export-Import Bank*	3,80 %	17.05.2031	2.647.205	0,11
3.983.426	Alfa Desarrollo SpA**	4,55 %	27.09.2051	3.033.960	0,12
2.556.000	Alibaba Group Holding Ltd*	3,25 %	09.02.2061	1.539.641	0,06
3.028.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,75 %	01.10.2030	2.628.856	0,10
3.283.000	Banco Nacional de Panama**	2,50 %	11.08.2030	2.637.152	0,11
3.143.000	Bank Leumi Le-Israel BM*	3,28 %	29.01.2031	2.796.029	0,11
17.663.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70 %	22.10.2031	15.128.303	0,61
12.145.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00 %	27.07.2027	11.476.124	0,46
5.905.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	5.335.876	0,21
10.385.877	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd**	0,00 %	05.06.2034	7.181.834	0,29
2.363.000	Blossom Joy Ltd*	3,10 %	29.12.2049	2.216.735	0,09
2.099.262	Brazil Loan Trust 1*	5,48 %	24.07.2023	2.108.247	0,08
9.850.200	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais†	5,33 %	15.02.2028	9.628.029	0,39
3.254.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	3.010.877	0,12
4.626.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	4.385.309	0,18
227.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd*	4,00 %	29.12.2049	221.931	0,01
639.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,13 %	03.06.2026	578.499	0,02
7.043.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	4,10 %	29.12.2049	6.871.699	0,28
8.482.000	Comision Federal de Electricidad*	3,35 %	09.02.2031	6.659.224	0,27
8.419.000	Comision Federal de Electricidad*	4,69 %	15.05.2029	7.483.221	0,30
4.988.000	Comision Federal de Electricidad*	6,26 %	15.02.2052	3.952.763	0,16
2.193.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,00 %	30.09.2029	1.919.489	0,08
6.749.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15 %	14.01.2030	5.969.487	0,24
2.378.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15 %	15.01.2051	1.665.698	0,07
6.844.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,70 %	30.01.2050	5.120.680	0,20
1.373.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	4,38 %	05.02.2049	1.167.252	0,05
150.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	6,15 %	24.10.2036	157.644	0,01

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 31,50 % (31. Dezember 2021: 32,17 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.870.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	5.614.197	0,22
9.306.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	7.382.172	0,30
4.794.000	CT Trust**	5,13 %	03.02.2032	4.216.502	0,17
4.314.000	DP World Crescent Ltd*	3,88 %	18.07.2029	4.043.883	0,16
3.400.000	DP World Ltd*	6,85 %	02.07.2037	3.624.814	0,14
5.914.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13 %	30.06.2028	4.911.394	0,20
6.949.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88 %	23.05.2024	6.707.522	0,27
5.626.000	Ecopetrol SA*	5,88 %	02.11.2051	3.791.880	0,15
5.120.000	Ecopetrol SA*	6,88 %	29.04.2030	4.654.682	0,19
5.783.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13 %	02.05.2049	4.669.483	0,19
5.719.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,45 %	16.09.2031	4.829.332	0,19
1.340.000	Empresa Nacional del Petroleo*	4,50 %	14.09.2047	1.023.163	0,04
2.231.000	Empresa Nacional del Petroleo**	4,50 %	14.09.2047	1.713.451	0,07
5.830.000	Empresa Nacional del Petroleo**	5,25 %	06.11.2029	5.663.601	0,23
4.784.191	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,16 %	31.03.2034	4.079.939	0,16
8.304.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	6.706.036	0,27
10.096.372	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94 %	30.09.2040	8.150.519	0,33
397.000	Georgian Railway JSC*	4,00 %	17.06.2028	351.345	0,01
5.777.750	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	4.852.311	0,19
9.182.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	7.465.425	0,30
1.685.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	1.489.019	0,06
2.633.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	2.425.460	0,10
5.640.000	KazMunayGas National Co JSC*	3,50 %	14.04.2033	4.212.420	0,17
2.068.000	KazMunayGas National Co JSC*	4,75 %	24.04.2025	2.009.147	0,08
34.227.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38 %	24.04.2030	30.819.307	1,24
17.847.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75 %	19.04.2047	13.921.359	0,56
8.734.000	KazMunayGas National Co JSC*	6,38 %	24.10.2048	7.230.852	0,29
1.323.000	Leader Goal International Ltd*	4,25 %	29.12.2049	1.322.426	0,05
6.221.887	Leviathan Bond Ltd*	6,75 %	30.06.2030	5.889.843	0,24
16.591.000	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	13.713.422	0,55
2.196.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	5,50 %	28.04.2033	2.326.297	0,09
5.728.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38 %	30.01.2027	5.187.232	0,21
2.334.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	1.802.106	0,07
3.734.000	Mexico City Airport Trust*	5,50 %	31.07.2047	2.883.936	0,11
19.083.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38 %	29.12.2049	18.367.388	0,74
4.496.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50 %	29.12.2049	4.139.791	0,17
11.154.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	10.461.114	0,42
6.754.000	NWD MTN Ltd*	4,13 %	18.07.2029	5.488.702	0,22
17.067.000	Oil & Gas Holding Co BSCC**	7,50 %	25.10.2027	17.496.508	0,70
1.382.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	7,63 %	07.11.2024	1.409.249	0,06

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 31,50 % (31. Dezember 2021: 32,17 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.043.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63 %	08.04.2031	3.483.974	0,14
4.474.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III*	4,70 %	06.06.2032	4.410.522	0,18
2.675.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,38 %	05.02.2050	2.009.271	0,08
8.423.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,25 %	15.05.2047	7.121.857	0,29
13.882.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	6,15 %	21.05.2048	13.211.846	0,53
11.455.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,38 %	12.04.2027	558.431	0,02
730.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,50 %	12.04.2037	35.614	0,00
38.698.964	Petroleos de Venezuela SA*	6,00 %	16.05.2024	1.983.322	0,08
26.169.079	Petroleos de Venezuela SA**	6,00 %	15.11.2026	1.275.743	0,05
5.618.000	Petroleos del Peru SA*	4,75 %	19.06.2032	4.352.265	0,17
25.851.000	Petroleos del Peru SA*	5,63 %	19.06.2047	16.953.732	0,68
3.138.000	Petroleos Mexicanos*	6,35 %	12.02.2048	1.925.555	0,08
7.161.000	Petroleos Mexicanos*	6,75 %	21.09.2047	4.585.072	0,18
14.105.000	Petroleos Mexicanos*	6,95 %	28.01.2060	8.948.192	0,36
82.010.000	Petroleos Mexicanos*	7,69 %	23.01.2050	56.930.005	2,28
3.706.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95 %	23.04.2030	3.260.264	0,13
2.898.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd*	3,08 %	29.12.2049	2.671.956	0,11
4.596.000	QatarEnergy Trading LLC*	3,30 %	12.07.2051	3.405.999	0,14
3.147.000	QNB Finance Ltd*	2,75 %	12.02.2027	2.893.729	0,12
10.097.000	Reliance Industries Ltd*	2,88 %	12.01.2032	8.195.397	0,33
9.411.000	Reliance Industries Ltd*	3,63 %	12.01.2052	6.193.447	0,25
5.850.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88 %	27.03.2024	5.737.356	0,23
10.610.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	9.656.092	0,39
20.864.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,25 %	16.04.2039	18.722.352	0,75
2.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd*	4,10 %	28.04.2045	1.651.862	0,07
9.432.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,30 %	08.01.2031	7.940.899	0,32
2.645.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	3,35 %	13.05.2050	1.847.526	0,07
2.904.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	3,68 %	08.08.2049	2.187.392	0,09
60.292.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88 %	24.03.2026	62.097.978	2,49
6.947.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	4,75 %	13.03.2023	6.922.810	0,28
27.591.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	6,95 %	18.03.2030	28.507.347	1,14
4.696.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	4.695.446	0,19
1.876.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	1.688.447	0,07
6.803.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	4.313.526	0,17
778.000	Tencent Holdings Ltd**	3,29 %	03.06.2060	467.861	0,02
1.900.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	2,63 %	15.08.2025	1.632.081	0,06
5.985.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25 %	15.08.2030	4.282.447	0,17
5.469.000	TSMC Arizona Corp*	4,25 %	22.04.2032	5.304.656	0,21
4.752.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	6,50 %	08.01.2026	4.500.974	0,18
71.250	Ukreximbank Via Biz Finance Plc*	9,75 %	22.01.2025	26.156	0,00

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 31,50 % (31. Dezember 2021: 32,17 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.640.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	3.157.845	0,13
4.472.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	3.900.221	0,16
3.050.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13 %	31.05.2023	2.865.579	0,11
450.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*	6,80 %	22.11.2025	27.519	0,00
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>770.315.416</b>	<b>30,91</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>784.977.470</b>	<b>31,50</b>
<b>Staatsanleihen 60,52 % (31. Dezember 2021: 61,99 %)</b>					
<b>Euro</b>					
1.825.000	Benin Government International Bond*	4,88 %	19.01.2032	1.519.754	0,06
9.589.000	Benin Government International Bond*	4,95 %	22.01.2035	7.483.201	0,30
1.367.000	Benin Government International Bond*	6,88 %	19.01.2052	1.064.793	0,04
1.800.000	Chile Government International Bond*	0,83 %	02.07.2031	1.504.414	0,06
1.400.000	Chile Government International Bond*	1,88 %	27.05.2030	1.294.768	0,05
1.757.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	11.04.2025	1.677.921	0,07
4.170.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	16.04.2026	3.713.007	0,15
10.344.000	Egypt Government International Bond*	5,63 %	16.04.2030	7.689.767	0,31
28.113.000	Egypt Government International Bond*	6,38 %	11.04.2031	20.941.732	0,84
1.882.000	Hungary Government International Bond*	1,75 %	05.06.2035	1.326.157	0,05
12.489.000	Indonesia Government International Bond*	1,10 %	12.03.2033	9.781.225	0,39
31.391.000	Indonesia Government International Bond*	1,40 %	30.10.2031	26.254.790	1,05
4.379.000	Indonesia Government International Bond*	3,75 %	14.06.2028	4.562.133	0,18
4.420.000	Ivory Coast Government International Bond*	4,88 %	30.01.2032	3.753.136	0,15
17.469.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,25 %	22.03.2030	15.798.013	0,63
26.410.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,63 %	22.03.2048	20.030.049	0,80
34.005.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88 %	17.10.2040	27.581.280	1,11
4.950.000	Kazakhstan Government International Bond*	1,50 %	30.09.2034	3.935.586	0,16
1.018.000	Kazakhstan Government International Bond*	2,38 %	09.11.2028	983.537	0,04
6.401.000	Mexico Government International Bond*	2,38 %	11.02.2030	5.999.480	0,24
32.222.000	Peruvian Government International Bond*	1,25 %	11.03.2033	24.065.118	0,97
18.107.000	Peruvian Government International Bond*	1,95 %	17.11.2036	13.377.415	0,54
13.993.000	Peruvian Government International Bond*	3,75 %	01.03.2030	13.911.571	0,56
5.493.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	4.046.797	0,16
2.675.372	Provincia de Buenos Aires*	4,00 %	01.09.2037	888.766	0,04
9.677.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95 %	07.07.2032	7.700.185	0,31
3.470.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	2.487.346	0,10
9.942.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	14.04.2033	6.839.396	0,27
856.000	Romanian Government International Bond*	2,12 %	16.07.2031	632.843	0,03
6.016.000	Romanian Government International Bond*	2,63 %	02.12.2040	3.610.572	0,14

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 60,52 % (31. Dezember 2021: 61,99 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
3.683.000	Romanian Government International Bond*	2,88 %	13.04.2042	2.220.092	0,09
30.775.000	Romanian Government International Bond*	3,38 %	28.01.2050	19.085.524	0,77
1.000.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	879.229	0,04
26.696.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	21.374.792	0,86
22.000.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	17.393.131	0,70
5.272.000	Romanian Government International Bond*	4,63 %	03.04.2049	4.128.223	0,17
8.897.000	Senegal Government International Bond*	4,75 %	13.03.2028	8.217.848	0,33
33.379.000	Serbia International Bond*	1,50 %	26.06.2029	25.649.396	1,03
5.899.000	Serbia International Bond*	1,65 %	03.03.2033	3.842.856	0,15
12.017.000	Serbia International Bond*	2,05 %	23.09.2036	7.283.509	0,29
833.000	Serbia International Bond*	3,13 %	15.05.2027	767.678	0,03
6.760.000	Tunisian Republic*	5,63 %	17.02.2024	5.686.779	0,23
9.031.000	Tunisian Republic*	6,38 %	15.07.2026	6.107.148	0,24
8.615.000	Ukraine Government International Bond**	6,75 %	20.06.2028	1.704.864	0,07
<b>Euro insgesamt</b>				<b>368.795.821</b>	<b>14,80</b>
<b>US-Dollar</b>					
8.724.000	Abu Dhabi Government International Bond*	2,70 %	02.09.2070	5.464.167	0,22
8.613.000	Abu Dhabi Government International Bond*	3,00 %	15.09.2051	6.197.596	0,25
6.943.000	Angolan Government International Bond*	8,25 %	09.05.2028	6.353.060	0,25
14.387.000	Angolan Government International Bond*	8,75 %	14.04.2032	12.510.191	0,50
10.084.000	Angolan Government International Bond*	9,13 %	26.11.2049	7.916.953	0,32
44.993.000	Angolan Government International Bond*	9,38 %	08.05.2048	35.777.946	1,44
30.904.000	Arab Republic of Egypt*	8,88 %	29.05.2050	21.003.007	0,84
97.187.890	Argentine Republic Government International Bond*	0,50 %	09.07.2030	26.453.537	1,06
23.087.184	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	6.186.382	0,25
152.770.568	Argentine Republic Government International Bond*	1,50 %	09.07.2035	39.131.513	1,57
11.700.000	Bahamas Government International Bond*	6,00 %	21.11.2028	9.046.725	0,36
2.674.000	Bermuda Government International Bond*	2,38 %	20.08.2030	2.268.988	0,09
1.809.000	Bermuda Government International Bond*	3,72 %	25.01.2027	1.747.946	0,07
14.898.000	Bermuda Government International Bond*	4,75 %	15.02.2029	14.885.775	0,60
6.658.000	Bermuda Government International Bond*	5,00 %	15.07.2032	6.625.803	0,27
4.770.000	Brazilian Government International Bond*	5,00 %	27.01.2045	3.549.606	0,14
10.659.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	07.01.2041	9.054.011	0,36
16.310.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	21.02.2047	12.975.800	0,52
6.492.000	Chile Government International Bond*	3,25 %	21.09.2071	4.020.915	0,16
3.080.000	Chile Government International Bond*	3,50 %	31.01.2034	2.631.623	0,11
30.795.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	23.645.578	0,95
37.182.000	Colombia Government International Bond*	5,00 %	15.06.2045	25.434.566	1,02
31.867.000	Colombia Government International Bond*	5,20 %	15.05.2049	21.823.664	0,88

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 60,52 % (31. Dezember 2021: 61,99 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.330.000	Colombia Government International Bond*	6,13 %	18.01.2041	3.458.701	0,14
7.962.000	Colombia Government International Bond*	8,00 %	20.04.2033	7.995.819	0,32
1.043.000	Corp Financiera de Desarrollo SA*	2,40 %	28.09.2027	873.674	0,04
2.809.000	Costa Rica Government International Bond*	7,00 %	04.04.2044	2.654.996	0,11
5.801.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16 %	12.03.2045	5.568.799	0,22
5.316.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25 %	23.10.2023	4.775.728	0,19
33.905.000	Dominican Republic International Bond*	5,88 %	30.01.2060	24.995.523	1,01
6.800.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	19.07.2028	6.579.049	0,26
17.427.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	22.02.2033	15.785.412	0,63
553.000	Dominican Republic International Bond*	6,40 %	05.06.2049	449.073	0,02
27.430.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	23.918.369	0,96
5.774.110	Ecuador Government International Bond*	0,00 %	31.07.2030	2.283.989	0,09
25.701.001	Ecuador Government International Bond*	1,50 %	31.07.2040	10.584.478	0,42
89.690.248	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2035	41.682.471	1,67
17.823.467	Ecuador Government International Bond*	5,50 %	31.07.2030	11.541.915	0,46
13.331.000	Egypt Government International Bond*	7,90 %	21.02.2048	8.466.518	0,34
8.088.000	Egypt Government International Bond*	8,15 %	20.11.2059	5.315.854	0,21
33.950.000	Egypt Government International Bond*	8,50 %	31.01.2047	22.708.306	0,91
20.863.000	Egypt Government International Bond*	8,70 %	01.03.2049	13.982.883	0,56
6.658.000	El Salvador Government International Bond*	7,12 %	20.01.2050	2.635.520	0,10
1.040.000	El Salvador Government International Bond*	7,63 %	01.02.2041	412.175	0,02
2.462.000	El Salvador Government International Bond*	7,65 %	15.06.2035	1.005.023	0,04
742.000	El Salvador Government International Bond*	8,63 %	28.02.2029	329.011	0,01
48.764.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	21.814.110	0,88
4.130.000	Emirate of Dubai Government International Bonds*	3,90 %	09.09.2050	2.977.146	0,12
2.000.000	Ghana Government International Bond*	6,38 %	11.02.2027	777.640	0,03
13.833.000	Ghana Government International Bond*	7,63 %	16.05.2029	5.205.358	0,21
15.125.000	Ghana Government International Bond*	7,75 %	07.04.2029	5.687.000	0,23
12.017.000	Ghana Government International Bond*	7,88 %	11.02.2035	4.347.150	0,17
11.138.000	Ghana Government International Bond*	8,63 %	07.04.2034	4.089.317	0,16
5.375.000	Ghana Government International Bond*	8,75 %	11.03.2061	1.895.332	0,08
4.857.000	Ghana Government International Bond*	8,88 %	07.05.2042	1.745.047	0,07
8.151.000	Ghana Government International Bond*	8,95 %	26.03.2051	2.919.118	0,12
31.534.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	22.348.145	0,90
7.537.000	Guatemala Government Bond*	3,70 %	07.10.2033	6.242.173	0,25
1.729.000	Guatemala Government Bond*	4,65 %	07.10.2041	1.396.931	0,06
1.100.000	Guatemala Government Bond*	4,88 %	13.02.2028	1.063.309	0,04
2.035.000	Guatemala Government Bond*	5,25 %	10.08.2029	1.961.029	0,08
7.190.000	Guatemala Government Bond*	5,38 %	24.04.2032	7.054.109	0,28
3.260.000	Honduras Government International Bond*	5,63 %	24.06.2030	2.629.489	0,11

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 60,52 % (31. Dezember 2021: 61,99 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.247.000	Honduras Government International Bond*	6,25 %	19.01.2027	1.103.367	0,04
5.600.000	Indonesia Government International Bond*	5,13 %	15.01.2045	5.446.376	0,22
15.265.000	Indonesia Government International Bond*	5,25 %	17.01.2042	15.045.758	0,60
400.000	Indonesia Government International Bond*	7,75 %	17.01.2038	482.000	0,02
11.437.000	Indonesia Government International Bond*	8,50 %	12.10.2035	14.536.033	0,58
10.884.500	Iraq International Bond*	5,80 %	15.01.2028	10.065.460	0,40
7.336.510	Ivory Coast Government International Bond*	5,75 %	31.12.2032	6.957.249	0,28
45.992.000	Lebanon Government International Bond*	6,38 %	01.01.2025	2.835.867	0,11
21.038.000	Lebanon Government International Bond*	6,60 %	27.11.2026	1.288.074	0,05
58.532.000	Lebanon Government International Bond*	6,65 %	26.02.2030	3.573.379	0,14
6.112.000	Lebanon Government International Bond*	6,85 %	25.05.2029	374.360	0,01
83.325.000	Lebanon Government International Bond*	8,25 %	17.05.2034	5.166.567	0,21
3.205.000	Mexico Government International Bond*	4,88 %	19.05.2033	2.948.414	0,12
44.844.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	37.897.866	1,52
11.771.000	Mongolia Government International Bond*	3,50 %	07.07.2027	9.506.337	0,38
8.042.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	6.956.915	0,28
18.199.000	Mongolia Government International Bond*	8,75 %	09.03.2024	17.653.110	0,71
3.300.000	Morocco Government International Bond*	5,50 %	11.12.2042	2.842.449	0,11
328.000	Nigeria Government International Bond*	7,63 %	21.11.2025	303.401	0,01
2.059.000	Nigeria Government International Bond*	7,70 %	23.02.2038	1.417.641	0,06
13.081.000	Nigeria Government International Bond*	7,88 %	16.02.2032	9.901.516	0,40
3.326.000	Nigeria Government International Bond*	8,38 %	24.03.2029	2.767.032	0,11
2.665.000	Nigeria Government International Bond*	8,75 %	21.01.2031	2.188.945	0,09
40.685.000	Oman Government International Bond*	6,75 %	17.01.2048	38.274.374	1,54
2.960.000	Oman Government International Bond*	7,00 %	25.01.2051	2.873.186	0,12
15.411.000	Panama Government International Bond*	6,40 %	14.02.2035	15.679.305	0,63
14.050.000	Panama Government International Bond*	6,70 %	26.01.2036	14.694.125	0,59
7.524.000	Papua New Guinea Government International Bond*	8,38 %	04.10.2028	6.587.262	0,26
1.032.000	Paraguay Government International Bond*	3,85 %	28.06.2033	909.786	0,04
14.691.000	Paraguay Government International Bond*	4,95 %	28.04.2031	14.252.158	0,58
5.175.000	Paraguay Government International Bond*	5,40 %	30.03.2050	4.478.679	0,18
11.382.000	Paraguay Government International Bond*	5,60 %	13.03.2048	9.979.921	0,40
7.391.000	Paraguay Government International Bond*	6,10 %	11.08.2044	7.138.155	0,29
6.329.000	Peruvian Government International Bond*	3,00 %	15.01.2034	5.005.629	0,20
1.800.000	Peruvian Government International Bond*	8,75 %	21.11.2033	2.195.592	0,09
1.612.000	Philippine Government International Bond*	5,61 %	13.04.2033	1.709.358	0,07
647.997	Provincia de Cordoba*	6,88 %	10.12.2025	525.688	0,02
3.939.000	Provincia de Mendoza Argentina*	4,25 %	19.03.2029	2.995.945	0,12
7.600.000	Qatar Government International Bond*	4,40 %	16.04.2050	6.984.635	0,28
34.587.000	Qatar Government International Bond*	4,82 %	14.03.2049	33.792.760	1,36



## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 60,52 % (31. Dezember 2021: 61,99 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
6.046.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60 %	02.02.2031	4.836.740	0,19
1.800.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	5,13 %	01.09.2029	1.707.074	0,07
11.940.000	Republic of Kenya Government International Bond*	8,00 %	22.05.2032	10.239.854	0,41
7.122.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,75 %	16.11.2032	7.608.169	0,31
1.456.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,65 %	27.09.2047	1.075.211	0,04
32.608.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75 %	30.09.2049	24.091.834	0,97
19.450.000	Republic of South Africa Government International Bond*	7,30 %	20.04.2052	16.844.672	0,68
6.401.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	4,75 %	20.02.2024	6.279.829	0,25
11.490.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	5,38 %	20.02.2029	10.699.429	0,43
11.443.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,75 %	18.04.2023	3.632.659	0,15
2.503.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,88 %	21.02.2023	826.335	0,03
6.070.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,13 %	03.06.2025	1.987.103	0,08
19.443.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20 %	11.05.2027	6.203.868	0,25
16.169.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	5.178.154	0,21
15.086.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	4.805.209	0,19
15.820.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	03.11.2025	5.103.417	0,20
18.879.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55 %	28.03.2030	6.023.907	0,24
43.860.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85 %	14.03.2029	14.046.251	0,56
6.462.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25 %	24.06.2030	1.154.695	0,05
4.040.000	Turkey Government International Bond*	5,88 %	26.06.2031	3.325.364	0,13
12.028.000	Turkey Government International Bond*	6,00 %	14.01.2041	8.770.062	0,35
4.117.000	UAE International Government Bond*	4,95 %	07.07.2052	4.120.978	0,17
15.381.000	Ukraine Government International Bond*	0,00 %	01.08.2041	4.534.319	0,18
5.161.000	Ukraine Government International Bond*	6,88 %	21.05.2031	1.006.395	0,04
1.713.000	Ukraine Government International Bond*	7,25 %	15.03.2035	324.173	0,01
14.203.000	Ukraine Government International Bond*	7,38 %	25.09.2034	2.708.356	0,11
6.784.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	1.486.544	0,06
14.549.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	3.170.824	0,13
14.305.000	Ukraine Government International Bond*	9,75 %	01.11.2030	2.964.282	0,12
9.514.000	Uzbekneftegaz JSC*	4,75 %	16.11.2028	7.662.956	0,31
32.118.500	Venezuela Government International Bond*	8,25 %	13.10.2024	2.810.369	0,11
9.117.000	Zambia Government International Bond*	5,38 %	30.12.2023	3.862.873	0,16
710.000	Zambia Government International Bond*	8,50 %	14.04.2024	325.594	0,01
30.247.000	Zambia Government International Bond*	8,97 %	30.07.2027	13.611.906	0,55
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>1.139.225.120</b>	<b>45,72</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>1.508.020.941</b>	<b>60,52</b>

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Investmentfonds 0,65 % (31. Dezember 2021: 0,46 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
150.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	16.110.000	0,65
<b>Investmentfonds insgesamt <sup>1)</sup></b>		<b>16.110.000</b>	<b>0,65</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>2.309.108.411</b>	<b>92,67</b>

**Devisenterminkontrakte 0,50 % (31. Dezember 2021: 0,34 %)**

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
24.022.840 AUD	16.167.636 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	170.687	0,01
375.478 AUD	252.784 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	10	2.583	0,00
17.983 US\$	26.122 AUD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	217	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
5.989.522 CHF	6.445.371 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	78.338	0,00
179.868.928 CHF	193.597.597 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	9	2.313.301	0,09
304.653 US\$	279.514 CHF	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	209	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
4.757.915 €	5.024.154 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	78.305	0,00
649.273.056 €	687.172.392 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	9.117.649	0,37
14.013.822 €	14.976.792 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	13	51.839	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
7.093 £	8.547 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	1	0,00
1.602.770 US\$	1.309.672 £	15.03.2023	Westpac Banking Corp	16	24.565	0,00
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
499 HKD	64 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
1.313 US\$	10.228 HKD	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	1	0,00
1.439 US\$	11.207 HKD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	4	2	0,00
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
9.929.867 ¥	73.681 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	2.294	0,00
1.640.100.694 ¥	12.189.878 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	358.841	0,02
19.444.537 ¥	145.769 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	3.005	0,00
100.870 US\$	13.112.620 ¥	15.03.2023	UBS AG	1	542	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
105.711 SEK	10.160 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	4	26	0,00
1.119.473 US\$	11.529.065 SEK	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	8.494	0,00
1.305.646 US\$	13.416.433 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	12	12.795	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
157.238 SGD	116.898 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	471	0,00
17.197.177 SGD	12.680.960 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	19	155.734	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>2)</sup></b>					<b>12.379.899</b>	<b>0,50</b>

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,93 % (31. Dezember 2021: 0,40 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(340)	Euro-BOBL Future March 2023	1.455.089	0,06
(1.419)	Euro-Bund Future March 2023	12.864.930	0,52
(327)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	8.639.004	0,35
(52)	Euro-Schatz Future March 2023	72.701	0,00
344	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	91.375	0,00
1.635	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	25.548	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>23.148.647</b>	<b>0,93</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,08 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
USD 32.640.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on CDX.EM.38	1.909.636	0,08
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b>				<b>1.909.636</b>	<b>0,08</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>2.346.546.593</b>	<b>94,18</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,43 %) (31. Dezember 2021: (0,05 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
4.793 €	5.129 US\$	05.01.2023	Brown Brothers Harriman	2	(13)	(0,00)
12.044.753 US\$	11.318.406 €	05.01.2023	Brown Brothers Harriman	1	(35.674)	(0,00)
10.341.613 US\$	9.791.489 €	05.01.2023	HSBC Bank Plc	1	(109.096)	(0,01)
417.328.479 US\$	398.712.588 €	05.01.2023	UBS AG	1	(8.227.772)	(0,33)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
256.239 AUD	176.558 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	(2.285)	(0,00)
392.641 US\$	584.024 AUD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	15	(4.563)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
1.717.623 CHF	1.878.109 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(7.297)	(0,00)
22.952 CHF	25.128 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	4	(129)	(0,00)
1.629.051 US\$	1.497.109 CHF	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(1.581)	(0,00)
1.134.100 US\$	1.054.645 CHF	15.03.2023	UBS AG	1	(14.606)	(0,00)
653.316 US\$	603.697 CHF	15.03.2023	Westpac Banking Corp	15	(4.222)	(0,00)

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,43 %) (31. Dezember 2021: (0,05 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
6.117.514 €	6.566.288 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(5.775)	(0,00)
5.745.562 US\$	5.386.422 €	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(30.917)	(0,00)
13.641.960 US\$	12.846.668 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	20	(134.993)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
71.337.933 £	87.207.009 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	22	(1.242.054)	(0,05)
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
1.263.424 HKD	162.271 US\$	15.03.2023	UBS AG	3	(181)	(0,00)
32.256 HKD	4.146 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	7	(9)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
136.207 US\$	18.392.056 ¥	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(4.514)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
1.460.795.959 SEK	141.491.363 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	4	(724.261)	(0,03)
2.407.825 SEK	236.333 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	9	(4.307)	(0,00)
1.157.180 US\$	12.018.828 SEK	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(993)	(0,00)
13.715.607 US\$	142.363.806 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	(3.038)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
8.797 SGD	6.569 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
84.444 US\$	114.275 SGD	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(856)	(0,00)
125.227 US\$	169.047 SGD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	8	(957)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b>					<b>(10.560.096)</b>	<b>(0,43)</b>

### Futures-Kontrakte (0,05 %) (31. Dezember 2021: (0,02 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.586	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(932.459)	(0,04)
272	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	(154.047)	(0,00)
316	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	(222.281)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>(1.308.787)</b>	<b>(0,05)</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(11.868.883)</b>	<b>(0,48)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>2.334.677.710</b>	<b>93,70</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>157.027.218</b>	<b>6,30</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>2.491.704.928</b>	<b>100,00</b>

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	2.141.860.330	84,94
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	141.510.052	5,61
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	9.628.029	0,38
μ Investmentfonds	16.110.000	0,64
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	21.839.860	0,87
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	3.729.439	0,15
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>2.334.677.710</b>	<b>92,59</b>

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Einlagenzertifikate 1,34 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
50.000.000	Agricultural Bank of China*	0,00 %	29.03.2023	7.151.687	0,52
50.000.000	Bank Of China Ltd*	0,00 %	14.02.2023	7.054.987	0,51
30.000.000	Bank of Communications Co Ltd*	0,00 %	05.06.2023	4.285.503	0,31
<b>Einlagenzertifikat insgesamt</b>				<b>18.492.177</b>	<b>1,34</b>
<b>Unternehmensanleihen 1,62 % (31. Dezember 2021: 1,59 %)</b>					
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
20.000.000	Central Huijin Investment Ltd.**	3,50 %	03.11.2023	2.911.552	0,21
10.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd**	2,98 %	27.07.2024	1.450.757	0,10
20.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd**	3,66 %	25.02.2024	2.923.171	0,21
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>				<b>7.285.480</b>	<b>0,52</b>
<b>Kolumbianischer Peso</b>					
6.450.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	7,63 %	10.09.2024	1.191.330	0,09
49.079.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	8,38 %	08.11.2027	7.611.340	0,55
<b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>				<b>8.802.670</b>	<b>0,64</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
72.618.300	Comision Federal de Electricidad*	7,35 %	25.11.2025	3.453.490	0,25
62.682.200	Comision Federal de Electricidad*	8,18 %	23.12.2027	2.927.083	0,21
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>6.380.573</b>	<b>0,46</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>22.468.723</b>	<b>1,62</b>
<b>Staatsanleihen 92,36 % (31. Dezember 2021: 85,43 %)</b>					
<b>Chilenischer Peso</b>					
2.055.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	2,80 %	01.10.2033	1.979.260	0,14
5.865.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,50 %	01.03.2026	6.689.728	0,48
8.050.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,70 %	01.09.2030	9.268.909	0,67
2.335.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,00 %	01.03.2035	2.764.601	0,20
445.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,10 %	15.07.2050	537.087	0,04
3.570.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	7,00 %	01.05.2034	4.864.998	0,35
<b>Chilenischer Peso insgesamt</b>				<b>26.104.583</b>	<b>1,88</b>
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
30.000.000	China Development Bank**	2,73 %	11.11.2024	4.360.410	0,31
20.000.000	China Development Bank**	3,42 %	02.07.2024	2.934.966	0,21
10.000.000	China Development Bank**	3,76 %	14.08.2023	1.459.326	0,11
8.070.000	China Government Bond**	1,99 %	09.04.2025	1.156.634	0,08
40.000.000	China Government Bond**	2,24 %	25.05.2025	5.758.928	0,42

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 92,35 % (31. Dezember 2021: 85,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>					
660.000	China Government Bond**	2,36 %	02.07.2023	95.483	0,01
20.000.000	China Government Bond**	2,50 %	25.07.2027	2.873.615	0,21
10.000.000	China Government Bond**	2,56 %	21.10.2023	1.449.610	0,10
11.000.000	China Government Bond**	2,60 %	01.09.2032	1.556.000	0,11
10.700.000	China Government Bond**	2,62 %	25.09.2029	1.529.721	0,11
2.950.000	China Government Bond**	2,68 %	21.05.2030	422.324	0,03
65.000.000	China Government Bond**	2,69 %	12.08.2026	9.438.531	0,68
13.000.000	China Government Bond**	2,69 %	15.08.2032	1.851.752	0,13
3.000.000	China Government Bond**	2,75 %	17.02.2032	429.681	0,03
27.000.000	China Government Bond**	2,76 %	15.05.2032	3.867.940	0,28
50.000.000	China Government Bond**	2,85 %	04.06.2027	7.304.628	0,53
30.000.000	China Government Bond**	2,91 %	14.10.2028	4.381.322	0,32
50.000.000	China Government Bond**	3,01 %	13.05.2028	7.341.281	0,53
60.000.000	China Government Bond**	3,02 %	22.10.2025	8.822.710	0,64
22.000.000	China Government Bond**	3,02 %	27.05.2031	3.224.903	0,23
20.000.000	China Government Bond**	3,03 %	11.03.2026	2.943.631	0,21
800.000	China Government Bond**	3,12 %	05.12.2026	118.080	0,01
30.380.000	China Government Bond**	3,13 %	21.11.2029	4.509.148	0,33
20.000.000	China Government Bond**	3,19 %	11.04.2024	2.927.465	0,21
10.000.000	China Government Bond**	3,25 %	22.11.2028	1.489.752	0,11
40.000.000	China Government Bond**	3,27 %	19.11.2030	5.991.522	0,43
20.000.000	China Government Bond**	3,28 %	03.12.2027	2.977.214	0,22
5.000.000	China Government Bond**	3,29 %	23.05.2029	750.191	0,05
250.000	China Government Bond**	3,39 %	16.03.2050	36.748	0,00
50.650.000	China Government Bond**	3,72 %	12.04.2051	7.936.531	0,57
18.000.000	China Government Bond**	3,81 %	14.09.2050	2.861.213	0,21
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>				<b>102.801.260</b>	<b>7,42</b>
<b>Kolumbianischer Peso</b>					
1.914.000.000	Colombia Government International Bond*	4,38 %	21.03.2023	387.828	0,03
34.291.992.416	Colombian TES*	2,25 %	18.04.2029	5.818.032	0,42
117.909.900.000	Colombian TES*	5,75 %	03.11.2027	18.445.345	1,33
87.177.400.000	Colombian TES*	6,00 %	28.04.2028	13.455.399	0,97
119.197.800.000	Colombian TES*	7,00 %	26.03.2031	17.411.701	1,25
10.400.100.000	Colombian TES Series G*	7,00 %	26.03.2031	1.519.184	0,11
3.050.700.000	Colombian TES*	7,00 %	30.06.2032	429.271	0,03
26.308.300.000	Colombian TES*	7,25 %	18.10.2034	3.586.285	0,26
56.372.100.000	Colombian TES*	7,50 %	26.08.2026	9.947.896	0,72

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 92,35 % (31. Dezember 2021: 85,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Kolumbianischer Peso (Fortsetzung)</b>					
22.429.000.000	Colombian TES*	9,25 %	28.05.2042	3.352.592	0,24
1.303.000.000	Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter*	7,88 %	12.08.2024	244.527	0,02
<b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>				<b>74.598.060</b>	<b>5,38</b>
<b>Tschechische Krone</b>					
277.360.000	Czech Republic Government Bond*	0,05 %	29.11.2029	8.723.323	0,63
496.230.000	Czech Republic Government Bond*	0,95 %	15.05.2030	16.449.656	1,18
368.120.000	Czech Republic Government Bond*	1,00 %	26.06.2026	14.109.813	1,02
215.890.000	Czech Republic Government Bond*	1,20 %	13.03.2031	7.101.419	0,51
52.680.000	Czech Republic Government Bond*	1,75 %	23.06.2032	1.757.397	0,13
79.870.000	Czech Republic Government Bond*	2,00 %	13.10.2033	2.661.698	0,19
451.530.000	Czech Republic Government Bond*	2,40 %	17.09.2025	18.531.007	1,34
42.300.000	Czech Republic Government Bond*	2,50 %	25.08.2028	1.626.529	0,12
29.020.000	Czech Republic Government Bond*	2,75 %	23.07.2029	1.111.884	0,08
35.400.000	Czech Republic Government Bond*	4,20 %	04.12.2036	1.448.866	0,10
<b>Tschechische Krone insgesamt</b>				<b>73.521.592</b>	<b>5,30</b>
<b>Peso Dominikanische Republik</b>					
152.700.000	Dominican Republic International Bond*	9,75 %	05.06.2026	2.610.187	0,19
<b>Peso Dominikanische Republik insgesamt</b>				<b>2.610.187</b>	<b>0,19</b>
<b>Ghanaischer Cedi</b>					
28.061.000	Republic of Ghana Government Bonds*	19,25 %	18.12.2023	2.336.105	0,17
18.517.000	Republic of Ghana Government Bonds*	20,75 %	06.03.2023	1.772.632	0,13
<b>Ghanaischer Cedi insgesamt</b>				<b>4.108.737</b>	<b>0,30</b>
<b>Ungarischer Forint</b>					
2.891.560.000	Hungary Government Bond*	4,50 %	23.03.2028	5.996.791	0,43
<b>Ungarischer Forint insgesamt</b>				<b>5.996.791</b>	<b>0,43</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>					
103.614.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,63 %	15.05.2023	6.666.352	0,48
72.466.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,13 %	15.05.2028	4.559.060	0,33
303.600.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.08.2028	19.337.794	1,39
12.550.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	776.538	0,06
11.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.07.2037	681.534	0,05
25.223.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50 %	15.02.2031	1.575.896	0,11
156.481.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.05.2033	9.787.336	0,71
64.288.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.05.2027	4.236.462	0,30
56.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	3.605.067	0,26



## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 92,35 % (31. Dezember 2021: 85,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>					
80.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2042	5.157.184	0,37
40.200.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2043	2.587.911	0,19
97.706.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.08.2032	6.501.350	0,47
102.493.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.06.2035	6.792.938	0,49
20.280.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.05.2038	1.343.388	0,10
120.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.04.2040	7.937.684	0,57
213.305.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,13 %	15.05.2024	14.141.244	1,02
39.425.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2029	2.729.569	0,20
112.362.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2036	7.880.050	0,57
129.017.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2024	8.562.921	0,62
58.565.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.09.2026	4.025.306	0,29
88.577.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2034	6.237.172	0,45
133.837.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,75 %	15.05.2031	9.595.046	0,69
33.258.000.000	Indonesia Treasury Bond*	9,00 %	15.03.2029	2.379.493	0,17
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>				<b>137.097.295</b>	<b>9,89</b>
<b>Japanischer Yen</b>					
11.253.000	Argentine Republic Government International Bond**	0,67 %	31.12.2038	17.016	0,00
7.424.445	Argentine Republic Government International Bond**	4,33 %	31.12.2033	15.405	0,00
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>				<b>32.421</b>	<b>0,00</b>
<b>Malaysischer Ringgit</b>					
31.322.000	Malaysia Government Bond**	2,63 %	15.04.2031	6.414.002	0,46
27.226.000	Malaysia Government Bond**	3,50 %	31.05.2027	6.089.605	0,44
12.910.000	Malaysia Government Bond**	3,58 %	15.07.2032	2.813.698	0,20
31.882.000	Malaysia Government Bond**	3,73 %	15.06.2028	7.152.339	0,52
23.487.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	20.04.2023	5.332.485	0,39
44.819.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	22.05.2040	9.407.471	0,68
36.640.000	Malaysia Government Bond**	3,80 %	17.08.2023	8.329.294	0,60
41.512.000	Malaysia Government Bond**	3,83 %	05.07.2034	9.131.650	0,66
5.637.000	Malaysia Government Bond**	3,84 %	15.04.2033	1.250.269	0,09
111.535.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	16.11.2027	25.358.603	1,83
21.138.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	30.11.2026	4.810.552	0,35
14.690.000	Malaysia Government Bond**	3,91 %	15.07.2026	3.347.096	0,24
3.963.000	Malaysia Government Bond**	3,96 %	15.09.2025	904.168	0,07
40.210.000	Malaysia Government Bond**	4,06 %	30.09.2024	9.177.877	0,66
22.181.000	Malaysia Government Bond**	4,07 %	15.06.2050	4.592.970	0,33
9.113.000	Malaysia Government Bond**	4,23 %	30.06.2031	2.096.481	0,15
21.265.000	Malaysia Government Bond**	4,25 %	31.05.2035	4.849.313	0,35
13.000.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	30.04.2029	3.029.844	0,22

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 92,35 % (31. Dezember 2021: 85,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Malaysischer Ringgit (Fortsetzung)</b>					
14.210.000	Malaysia Government Bond**	4,64 %	07.11.2033	3.364.647	0,24
23.680.000	Malaysia Government Bond**	4,70 %	15.10.2042	5.594.971	0,40
11.855.000	Malaysia Government Bond**	4,89 %	08.06.2038	2.865.907	0,21
4.791.000	Malaysia Government Bond**	4,94 %	30.09.2043	1.156.462	0,08
26.306.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,07 %	30.09.2026	6.009.801	0,43
26.775.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,37 %	31.10.2028	6.197.672	0,45
<b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>				<b>139.277.177</b>	<b>10,05</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
128.617.800	Mexican Bonos*	5,00 %	06.03.2025	5.988.799	0,43
261.449.400	Mexican Bonos*	7,50 %	03.06.2027	12.658.942	0,91
1.553.573.600	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	73.834.259	5,33
171.430.200	Mexican Bonos*	7,75 %	13.11.2042	7.684.658	0,55
90.673.600	Mexican Bonos*	8,00 %	07.11.2047	4.152.962	0,30
466.117.400	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	23.280.695	1,68
349.723.000	Mexican Bonos*	8,50 %	18.11.2038	16.997.429	1,23
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>144.597.744</b>	<b>10,43</b>
<b>Peruanischer Sol</b>					
24.441.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	7,00 %	14.02.2024	6.264.869	0,45
7.536.000	Peru Government Bond*	5,35 %	12.08.2040	1.470.052	0,11
22.336.000	Peru Government Bond*	5,40 %	12.08.2034	4.690.333	0,34
3.458.000	Peru Government Bond*	5,94 %	12.02.2029	831.519	0,06
38.862.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	8.957.619	0,65
7.312.000	Peruvian Government International Bond**	5,20 %	12.09.2023	1.899.344	0,14
8.187.000	Peruvian Government International Bond*	5,40 %	12.08.2034	1.719.187	0,12
31.602.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	7.420.321	0,53
156.000	Peruvian Government International Bond**	8,20 %	12.08.2026	42.814	0,00
<b>Peruanischer Sol insgesamt</b>				<b>33.296.058</b>	<b>2,40</b>
<b>Polnischer Zloty</b>					
86.722.000	Republic of Poland Government Bond*	0,25 %	25.10.2026	15.473.834	1,11
43.303.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25 %	25.10.2030	6.643.492	0,48
261.572.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2026	51.501.725	3,71
69.845.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2027	13.277.287	0,96
56.930.000	Republic of Poland Government Bond**	2,75 %	25.04.2028	10.668.692	0,77
123.602.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75 %	25.10.2029	22.148.323	1,60
23.072.000	Republic of Poland Government Bond**	3,25 %	25.07.2025	4.828.732	0,35
<b>Polnischer Zloty insgesamt</b>				<b>124.542.085</b>	<b>8,98</b>

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 92,35 % (31. Dezember 2021: 85,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Rumänischer neuer Leu</b>					
126.410.000	Romania Government Bond*	2,50 %	25.10.2027	21.773.409	1,57
23.370.000	Romania Government Bond*	3,25 %	24.06.2026	4.410.395	0,32
24.355.000	Romania Government Bond*	3,65 %	24.09.2031	3.924.864	0,28
14.600.000	Romania Government Bond*	4,15 %	24.10.2030	2.484.621	0,18
22.535.000	Romania Government Bond*	4,75 %	11.10.2034	3.547.329	0,26
23.255.000	Romania Government Bond*	4,85 %	25.07.2029	4.225.181	0,30
42.390.000	Romania Government Bond*	5,00 %	12.02.2029	7.906.619	0,57
16.500.000	Romania Government Bond*	6,70 %	25.02.2032	3.258.571	0,24
19.200.000	Romania Government Bond*	8,25 %	29.09.2032	4.177.608	0,30
<b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>				<b>55.708.597</b>	<b>4,02</b>
<b>Serbischer Dinar</b>					
115.190.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	11.01.2026	991.613	0,07
80.900.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	20.08.2032	613.011	0,04
373.550.000	Serbia Treasury Bonds*	5,88 %	08.02.2028	3.267.545	0,24
<b>Serbischer Dinar insgesamt</b>				<b>4.872.169</b>	<b>0,35</b>
<b>Südafrikanischer Rand</b>					
474.946.872	Republic of South Africa Government Bond*	7,00 %	28.02.2031	22.550.063	1,63
1.347.249.105	Republic of South Africa Government Bond*	8,50 %	31.01.2037	62.967.475	4,54
212.690.415	Republic of South Africa Government Bond*	8,75 %	31.01.2044	9.760.767	0,70
967.328.079	Republic of South Africa Government Bond*	8,88 %	28.02.2035	47.957.406	3,46
268.452.094	Republic of South Africa Government Bond*	9,00 %	31.01.2040	12.796.079	0,92
362.544.305	Republic of South Africa Government Bond*	10,50 %	21.12.2026	22.565.047	1,63
<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>				<b>178.596.837</b>	<b>12,88</b>
<b>Thailändischer Baht</b>					
290.000.000	Thailand Government Bond**	1,00 %	17.06.2027	8.047.306	0,58
587.994.000	Thailand Government Bond**	1,45 %	17.12.2024	16.917.791	1,22
23.578.000	Thailand Government Bond*	1,59 %	17.12.2035	578.992	0,04
112.597.000	Thailand Government Bond**	1,60 %	17.06.2035	2.800.660	0,20
485.120.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.12.2031	13.472.229	0,97
257.646.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.06.2042	6.007.254	0,43
189.097.000	Thailand Government Bond**	2,13 %	17.12.2026	5.527.501	0,40
509.670.000	Thailand Government Bond**	2,40 %	17.12.2023	14.890.725	1,08
440.400.000	Thailand Government Bond**	2,65 %	17.06.2028	13.132.286	0,95
83.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.12.2028	2.501	0,00
27.836.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.06.2046	712.971	0,05
448.519.000	Thailand Government Bond**	3,30 %	17.06.2038	13.072.295	0,94
290.399.000	Thailand Government Bond**	3,40 %	17.06.2036	8.706.145	0,63

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 92,35 % (31. Dezember 2021: 85,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Thailändischer Baht (Fortsetzung)</b>					
75.159.000	Thailand Government Bond**	3,63 %	16.06.2023	2.194.314	0,16
211.333.000	Thailand Government Bond**	3,65 %	20.06.2031	6.652.650	0,48
272.450.000	Thailand Government Bond**	3,78 %	25.06.2032	8.636.891	0,62
5.000	Thailand Government Bond**	3,85 %	12.12.2025	153	0,00
136.225.000	Thailand Government Bond**	4,88 %	22.06.2029	4.574.775	0,33
<b>Thailändischer Baht insgesamt</b>				<b>125.927.439</b>	<b>9,08</b>
<b>Türkische Lira</b>					
254.103.098	Turkey Government Bond*	1,50 %	18.06.2025	18.929.286	1,37
<b>Türkische Lira insgesamt</b>				<b>18.929.286</b>	<b>1,37</b>
<b>Uganda-Schilling</b>					
29.942.900.000	Republic of Uganda Government Bonds*	14,25 %	22.06.2034	7.306.313	0,53
<b>Uganda-Schilling insgesamt</b>				<b>7.306.313</b>	<b>0,53</b>
<b>US-Dollar</b>					
37.546.527	Argentine Republic Government International Bond*	0,50 %	09.07.2030	10.219.775	0,74
1.535.072	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	411.334	0,03
17.314.571	Argentine Republic Government International Bond*	1,50 %	09.07.2035	4.435.052	0,32
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>15.066.161</b>	<b>1,09</b>
<b>Uruguayischer Peso</b>					
120.724.724	Uruguay Government International Bond*	8,25 %	21.05.2031	2.636.726	0,19
<b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>				<b>2.636.726</b>	<b>0,19</b>
<b>Sambischer Kwacha</b>					
92.909.000	Zambia Government Bond*	13,00 %	25.01.2031	2.725.498	0,20
<b>Sambischer Kwacha insgesamt</b>				<b>2.725.498</b>	<b>0,20</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>1.280.353.016</b>	<b>92,36</b>
<b>Anzahl der Anteile</b>	<b>Wertpapierbezeichnung</b>			<b>Zeitwert US\$</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
<b>Investmentfonds 1,09 % (31. Dezember 2021: 0,77 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
1.595.000	Neuberger Berman China Bond Fund			15.136.550	1,09
<b>Investmentfonds insgesamt <sup>#</sup></b>				<b>15.136.550</b>	<b>1,09</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>1.336.450.466</b>	<b>96,41</b>

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,08 % (31. Dezember 2021: 0,79 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
277.878.020 BRL	50.991.139 US\$	02.02.2023	Goldman Sachs International	2	1.326.312	0,10
624.162.638 BRL	115.703.520 US\$	01.03.2023	Goldman Sachs International	1	1.296.489	0,09
14.911.603 BRL	2.768.848 US\$	02.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	38.632	0,00
80.918.089 BRL	15.147.527 US\$	01.03.2023	Morgan Stanley	1	20.662	0,00
20.453.093.279 CLP	22.960.365 US\$	09.02.2023	Morgan Stanley	1	951.817	0,07
64.044.871 CNY	9.221.031 US\$	17.01.2023	Goldman Sachs International	1	45.826	0,00
123.941.929 CZK	5.040.605 €	16.03.2023	Citibank NA	1	49.101	0,00
297.253.947 CZK	12.121.157 €	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	151.876	0,01
195.611.384 EGP	6.685.283 US\$	20.03.2023	Goldman Sachs International	1	466.870	0,03
2.970.725 €	14.763.230 RON	09.02.2023	Citibank NA	1	734	0,00
2.519.739 €	12.508.447 RON	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	3.545	0,00
27.852.495 €	28.876.687 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	848.875	0,06
3.189.610 €	15.853.543 RON	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	240	0,00
2.538.733.630 HUF	6.129.246 €	10.01.2023	Barclays Bank Plc	1	208.001	0,02
3.849.241.792 HUF	9.236.171 €	06.01.2023	BNP Paribas	1	393.015	0,03
8.696.764.222 HUF	20.072.628 €	16.03.2023	Citibank NA	1	1.182.904	0,09
14.053.461.395 HUF	33.664.828 €	23.01.2023	Citibank NA	1	1.249.419	0,09
1.911.260.807 HUF	4.584.687 €	23.01.2023	Goldman Sachs International	1	163.194	0,01
8.696.764.222 HUF	20.485.451 €	16.03.2023	Standard Chartered Bank	1	740.156	0,05
262.987.589.949 IDR	16.861.421 US\$	24.01.2023	Citibank NA	1	160.851	0,01
7.123.606.682 KRW	5.433.720 US\$	19.01.2023	Deutsche Bank AG	1	228.678	0,02
8.734.378.894 KRW	6.716.177 US\$	08.02.2023	Goldman Sachs International	1	229.831	0,02
8.822.148.231 KRW	6.425.875 US\$	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	589.931	0,04
75.880.715 MXN	3.792.389 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	51.804	0,00
64.215.133 MYR	14.254.192 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	323.591	0,02
58.220.816 MYR	13.171.534 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	149.585	0,01
71.813.372 PEN	18.568.902 US\$	16.03.2023	Barclays Bank Plc	1	136.798	0,01
39.365.170 PHP	666.427 US\$	07.02.2023	Citibank NA	1	40.447	0,00
10.801.182 PLN	2.269.549 €	20.01.2023	Brown Brothers Harriman	1	34.283	0,00
43.808.705 PLN	9.223.526 €	05.01.2023	Citibank NA	1	142.577	0,01
40.395.278 PLN	8.452.957 €	20.01.2023	HSBC Bank Plc	1	165.522	0,01
29.771.981 PLN	6.236.798 €	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	114.693	0,01
29.687.470 PLN	6.223.825 €	20.01.2023	UBS AG	1	109.314	0,01
67.514.203 RON	13.563.578 €	09.02.2023	Barclays Bank Plc	1	20.118	0,00
55.032.901 RON	11.060.668 €	09.02.2023	Goldman Sachs International	2	11.500	0,00
9.548.591 SGD	7.051.579 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	70.923	0,01
276.525.496 THB	8.028.310 US\$	21.03.2023	Barclays Bank Plc	1	15.756	0,00
608.039.422 THB	17.665.243 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	11.178	0,00
505.354.841 THB	14.253.417 US\$	03.01.2023	Deutsche Bank AG	2	337.455	0,03

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,08 % (31. Dezember 2021: 0,79 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
245.572.347 TWD	7.979.346 US\$	03.01.2023	Citibank NA	1	10.514	0,00
43.510.380 TWD	1.355.105 US\$	30.01.2023	HSBC Bank Plc	1	63.721	0,01
9.431.069 US\$	49.771.711 BRL	01.03.2023	Goldman Sachs International	2	101.304	0,01
6.503.996 US\$	34.474.300 BRL	02.02.2023	Goldman Sachs International	1	13.351	0,00
27.779.649 US\$	134.309.882.151 COP	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	272.600	0,02
2.329.834 US\$	10.190.926 MYR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	16.343	0,00
8.041.007 US\$	245.572.347 TWD	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	33.164	0,00
1.468.563 US\$	13.951.345 GHS	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	118.518	0,01
10.269.614 US\$	49.952.633.846 COP	09.02.2023	Morgan Stanley	1	39.171	0,00
3.254.602 US\$	16.801.884 BRL	02.02.2023	State Street Bank and Trust Co	1	91.230	0,01
130.691.892 ZAR	7.532.763 US\$	16.03.2023	Morgan Stanley	2	101.500	0,01
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
34.500.662 AUD	23.220.876 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	13	243.583	0,02
281.901 US\$	409.417 AUD	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	3.450	0,00
18.425 US\$	26.742 AUD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	237	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
139.216 €	147.006 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	2.291	0,00
15.433.430 €	16.384.273 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	13	166.767	0,01
6 US\$	6 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
1.042 US\$	840 £	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	30	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
64.468 SEK	6.168 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	45	0,00
107.091.660 US\$	1.105.941.787 SEK	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	519.473	0,04
17.927 US\$	183.298 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	263	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
5.145 SGD	3.825 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	15	0,00
527.373 SGD	388.862 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	4.791	0,00
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
962 US\$	16.342 ZAR	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	7	0,00
955.759.509 ZAR	54.738.165 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	1.096.303	0,08
10.306.347 ZAR	595.803 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	10	6.285	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b>					<b>14.987.459</b>	<b>1,08</b>

### Zinsswap-Kontrakte 0,64 % (31. Dezember 2021: 0,71 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens	
MXN	512.441.055	31.08.2029	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,92 %	28D MXIBTIIE	2.405.281	0,17
COP	93.274.075.523	31.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,14 %	1D COOVIBR	1.969.753	0,14
MXN	198.851.383	10.11.2031	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,38 %	28D MXIBTIIE	840.185	0,06
BRL	23.266.207	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,26 %	1D BROIS	780.101	0,06

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,64 % (31. Dezember 2021: 0,71 %) (Fortsetzung)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
COP	85.928.260.876	13.04.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	8,37 %	1D COOVIBR	688.654	0,05
BRL	6.697.271	02.01.2023	Goldman Sachs Internationa <sup>1</sup>	(Zahlung)	10,84 %	1D BROIS	443.226	0,03
COP	16.091.111.994	06.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,40 %	1D COOVIBR	416.570	0,03
CZK	1.575.608.913	30.11.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	5,02 %	3-Monats-PRIBOR	363.040	0,03
BRL	3.000.000	02.01.2023	Goldman Sachs International	(Zahlung)	11,99 %	1D BROIS	290.576	0,02
PLN	56.231.338	14.12.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	5,70 %	6M WIBOR	256.532	0,02
COP	7.078.194.753	07.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,45 %	1D COOVIBR	180.738	0,01
BRL	70.829.782	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	12,68 %	1D BROIS	82.604	0,01
COP	8.472.548.430	11.08.2032	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,02 %	1D COOVIBR	78.530	0,01
BRL	70.666.599	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,77 %	1D BROIS	49.520	0,00
ZAR	1.516.583	26.06.2023	UBS London	(Zahlung)	8,16 %	3-Monats-JIBAR	274	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>							<b>8.845.584</b>	<b>0,64</b>

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.360.283.509</b>	<b>98,13</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2021: (0,37 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
50.641.350 BRL	9.691.345 US\$	06.01.2023	Goldman Sachs International	1	(103.956)	(0,01)
46.343.458.634 COP	9.626.809 US\$	06.01.2023	Barclays Bank Plc	1	(73.116)	(0,01)
14.431.485 €	5.971.123.590 HUF	10.01.2023	BNP Paribas	1	(472.729)	(0,03)
11.694.510 €	55.840.792 PLN	20.01.2023	Citibank NA	1	(218.675)	(0,02)
10.024.202 €	47.778.354 PLN	20.01.2023	Goldman Sachs International	1	(167.682)	(0,01)
19.323.211 €	20.634.880 US\$	04.01.2023	Goldman Sachs International	1	(12.192)	(0,00)
18.903.060 €	90.196.841 PLN	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(164.858)	(0,01)
6.012.001 €	2.506.204.690 HUF	23.01.2023	Goldman Sachs International	1	(213.803)	(0,02)
1.825.625 €	8.568.304 PLN	20.01.2023	HSBC Bank Plc	1	(218)	(0,00)
7.865.410 €	37.590.323 PLN	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(154.661)	(0,01)
100.338.547.516 IDR	6.495.245 US\$	05.01.2023	Goldman Sachs International	1	(41.894)	(0,00)
87.753.478.319 IDR	5.671.442 US\$	05.01.2023	HSBC Bank Plc	1	(27.509)	(0,00)
74.895.564.114 IDR	4.862.654 US\$	05.01.2023	Morgan Stanley	1	(45.688)	(0,00)
70.386.538 ILS	20.626.092 US\$	16.03.2023	Citibank NA	1	(598.697)	(0,04)
23.440.491 ILS	6.914.599 US\$	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(244.972)	(0,02)

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2021: (0,37 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
4.196.609 MYR	953.840 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.148)	(0,00)
7.950.430 US\$	276.525.496 THB	03.01.2023	Barclays Bank Plc	1	(33.560)	(0,00)
42.829.461 US\$	754.387.411 ZAR	16.03.2023	Barclays Bank Plc	1	(1.237.485)	(0,09)
32.729 US\$	649.722 MXN	15.03.2023	Barclays Bank Plc	1	(186)	(0,00)
4.476.868 US\$	70.028.060.198 IDR	15.03.2023	Citibank NA	1	(49.677)	(0,00)
5.736.202 US\$	5.449.337 €	04.01.2023	Citibank NA	2	(79.601)	(0,01)
7.980.720 US\$	245.572.347 TWD	03.01.2023	Citibank NA	1	(9.140)	(0,00)
6.992.725 US\$	225.200.013 TWD	30.01.2023	Citibank NA	1	(350.799)	(0,03)
6.813.168 US\$	6.782.379 €	20.01.2023	Citibank NA	1	(433.715)	(0,03)
16.862.827 US\$	262.987.589.949 IDR	05.01.2023	Citibank NA	1	(51.423)	(0,00)
3.375.685 US\$	18.142.751 BRL	02.02.2023	Goldman Sachs International	2	(40.140)	(0,00)
35.660.660 US\$	717.472.831 TRY	15.03.2023	Goldman Sachs International	2	(687.106)	(0,05)
19.274.911 US\$	671.827.023 THB	06.01.2023	Goldman Sachs International	1	(125.954)	(0,01)
5.496.325 US\$	7.807.254.370 KRW	08.02.2023	HSBC Bank Plc	1	(712.388)	(0,05)
25.587.206 US\$	24.420.698 €	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(475.772)	(0,04)
7.979.346 US\$	245.572.347 TWD	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(10.514)	(0,00)
2.741.995 US\$	12.044.211 MYR	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(22.362)	(0,00)
13.157.247 US\$	58.220.816 MYR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(59.738)	(0,01)
2.962.828 US\$	51.325.454 ZAR	16.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(35.308)	(0,00)
5.561.498 US\$	195.431.032 THB	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(81.090)	(0,01)
3.377.064 US\$	67.072.182 TRY	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(20.868)	(0,00)
8.018.307 US\$	11.352.158.114 KRW	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.009.488)	(0,07)
964.096 US\$	33.398.313 THB	03.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(198)	(0,00)
19.294.698 US\$	25.187.616.222 KRW	06.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(652.278)	(0,05)
7.699.984 US\$	41.591.462 BRL	01.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(96.384)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
437.281 AUD	301.033 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	(3.630)	(0,00)
95.083 US\$	140.719 AUD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	13	(625)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
175.753 €	188.644 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(164)	(0,00)
301.632 US\$	282.917 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	8	(1.772)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
72.889 £	89.093 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	(1.259)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
1.114.358.650 SEK	107.906.919 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	3	(523.655)	(0,04)
11.000 SEK	1.067 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	(7)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
71.941 US\$	97.531 SGD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	4	(860)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
12.126.552 US\$	211.706.434 ZAR	15.03.2023	UBS AG	2	(241.117)	(0,01)



## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2021: (0,37 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen ZAR (Fortsetzung)</i>						
352.608 US\$	6.144.580 ZAR	15.03.2023	Westpac Banking Corp	22	(6.350)	(0,00)
8.072.037 ZAR	473.639 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(2.079)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(9.665.447)</b>	<b>(0,69)</b>

### Futures-Kontrakte (0,05 %) (31. Dezember 2021: (0,01 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
99	Euro-Bund Future March 2023	(443.154)	(0,03)
339	South Korea 3-Year Bond Future March 2023	(233.239)	(0,02)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>			<b>(676.393) (0,05)</b>

### Zinsswap-Kontrakte (3,40 %) (31. Dezember 2021: (2,61 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens	
BRL	427.249	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,66 %	1D BROIS	(2.152)	(0,00)
BRL	52.135.595	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,61 %	1D BROIS	(9.784)	(0,00)
CLP	45.161.320	24.08.2030	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,15 %	1D CLICP	(11.037)	(0,00)
CLP	11.448.420.600	13.04.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,51 %	1D CLICP	(40.841)	(0,00)
PLN	40.042.997	18.11.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,33 %	6M WIBOR	(42.002)	(0,00)
MXN	34.061.309	08.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,21 %	28D MXIBTIIE	(134.205)	(0,01)
PLN	28.093.226	28.09.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,74 %	6M WIBOR	(269.195)	(0,02)
MXN	60.000.000	08.04.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	5,95 %	28D MXIBTIIE	(270.813)	(0,02)
BRL	47.654.667	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,58 %	1D BROIS	(273.789)	(0,02)
MXN	123.677.961	20.04.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,51 %	28D MXIBTIIE	(306.007)	(0,02)
MXN	76.391.828	28.05.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,16 %	28D MXIBTIIE	(327.894)	(0,02)
MXN	75.000.000	18.06.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,13 %	28D MXIBTIIE	(328.169)	(0,02)
MXN	378.682.086	22.09.2032	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,00 %	28D MXIBTIIE	(336.800)	(0,02)
BRL	48.420.200	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,63 %	1D BROIS	(349.749)	(0,03)
MXN	90.000.000	21.05.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,33 %	28D MXIBTIIE	(362.587)	(0,03)
MXN	94.552.835	05.03.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,17 %	28D MXIBTIIE	(391.442)	(0,03)
MXN	95.000.000	16.09.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,38 %	28D MXIBTIIE	(392.797)	(0,03)
BRL	65.515.347	02.01.2026	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,40 %	1D BROIS	(429.232)	(0,03)
HUF	3.508.092.051	05.08.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,87 %	6M BUBOR	(457.198)	(0,03)
BRL	49.758.514	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,33 %	1D BROIS	(481.825)	(0,03)
MXN	650.000.000	29.05.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,84 %	28D MXIBTIIE	(488.236)	(0,04)
CZK	361.114.425	06.12.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,51 %	6M PRIBOR	(489.721)	(0,04)
HUF	4.084.949.659	04.08.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,98 %	6M BUBOR	(492.064)	(0,04)
BRL	86.110.250	02.01.2026	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,57 %	1D BROIS	(522.284)	(0,04)
BRL	41.211.068	02.01.2029	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,40 %	1D BROIS	(533.941)	(0,04)
PLN	49.696.950	30.09.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,86 %	6M WIBOR	(573.654)	(0,04)

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (3,40 %) (31. Dezember 2021: (2,61 %)) (Fortsetzung)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
HUF	2.853.178.857	04.04.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,51 %	6M BUBOR	(585.006)	(0,04)
BRL	148.723.986	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,66 %	1D BROIS	(683.135)	(0,05)
BRL	149.442.185	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,72 %	1D BROIS	(709.571)	(0,05)
HUF	4.396.476.991	16.08.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,48 %	6M BUBOR	(709.639)	(0,05)
PLN	40.776.038	28.10.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	7,32 %	6M WIBOR	(766.257)	(0,06)
BRL	53.719.957	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,50 %	1D BROIS	(789.797)	(0,06)
BRL	40.209.304	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,82 %	1D BROIS	(916.320)	(0,07)
BRL	95.845.198	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,32 %	1D BROIS	(966.143)	(0,07)
HUF	4.881.963.292	31.03.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,61 %	6M BUBOR	(976.781)	(0,07)
CLP	14.329.438.219	03.10.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,30 %	1D CLICP	(1.005.498)	(0,07)
BRL	49.384.188	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,97 %	1D BROIS	(1.137.589)	(0,08)
CLP	37.098.536.620	14.09.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,30 %	1D CLICP	(1.175.796)	(0,09)
BRL	59.389.712	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,99 %	1D BROIS	(1.735.977)	(0,13)
HUF	2.100.366.692	11.11.2031	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,69 %	6M BUBOR	(1.888.596)	(0,14)
BRL	85.929.932	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,73 %	1D BROIS	(2.126.503)	(0,15)
BRL	107.195.155	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,76 %	1D BROIS	(2.198.480)	(0,16)
MXN	420.720.666	25.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,85 %	28D MXIBTIIE	(2.201.006)	(0,16)
HUF	2.716.863.191	04.10.2031	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,31 %	6M BUBOR	(2.534.818)	(0,18)
CLP	21.831.060.743	17.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	1,36 %	1D CLICP	(3.370.469)	(0,24)
CLP	21.997.154.748	23.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	1,16 %	1D CLICP	(3.525.736)	(0,25)
BRL	136.490.816	01.07.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,92 %	1D BROIS	(4.146.784)	(0,30)
BRL	138.112.873	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,65 %	1D BROIS	(4.639.135)	(0,33)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>							<b>(47.106.454)</b>	<b>(3,40)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert % des Netto- US\$ vermögens	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(57.448.294)</b>	<b>(4,14)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>1.302.835.215</b>	<b>93,99</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>83.429.228</b>	<b>6,01</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>1.386.264.443</b>	<b>100,00</b>

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	915.065.736	62,60
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	406.248.180	27,79
μ Investmentfonds	15.136.550	1,04
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(676.393)	(0,05)
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(32.938.858)	(2,25)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>1.302.835.215</b>	<b>89,13</b>

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %)</b>					
<b>Kolumbianischer Peso</b>					
4.060.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	7,63 %	10.09.2024	749.891	0,16
17.077.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	8,38 %	08.11.2027	2.648.360	0,56
<b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>				<b>3.398.251</b>	<b>0,72</b>
<b>Euro</b>					
2.082.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13 %	19.07.2024	398.018	0,08
821.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	1,88 %	05.11.2031	634.305	0,14
<b>Euro insgesamt</b>				<b>1.032.323</b>	<b>0,22</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
46.510.400	Comision Federal de Electricidad*	7,35 %	25.11.2025	2.211.883	0,47
43.963.800	Comision Federal de Electricidad*	8,18 %	23.12.2027	2.052.986	0,44
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>4.264.869</b>	<b>0,91</b>
<b>US-Dollar</b>					
2.000.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40 %	09.03.2023	1.958.155	0,42
700.000	ABQ Finance Ltd*	3,13 %	24.09.2024	672.620	0,14
537.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	4,50 %	14.09.2027	530.223	0,11
1.439.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60 %	02.11.2047	1.326.630	0,28
400.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	2,00 %	29.04.2028	356.119	0,08
700.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95 %	12.02.2030	536.235	0,11
200.000	Aegea Finance Sarl*	6,75 %	20.05.2029	197.563	0,04
362.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**	5,13 %	11.08.2061	297.512	0,06
538.000	Africa Finance Corp*	2,88 %	28.04.2028	464.507	0,10
497.000	African Export-Import Bank*	3,99 %	21.09.2029	432.771	0,09
200.000	AIA Group Ltd*	3,20 %	16.09.2040	143.102	0,03
250.000	AIA Group Ltd**	3,38 %	07.04.2030	220.234	0,05
400.000	Akbank TAS*	5,13 %	31.03.2025	385.560	0,08
400.000	Akbank TAS**	6,80 %	06.02.2026	387.392	0,08
839.927	Alfa Desarrollo SpA**	4,55 %	27.09.2051	639.727	0,14
800.000	Alfa SAB de CV**	6,88 %	25.03.2044	782.695	0,17
394.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00 %	06.12.2037	329.416	0,07
775.000	Alpek SAB de CV*	3,25 %	25.02.2031	646.903	0,14
300.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	297.966	0,06
500.000	Altice Financing SA*	5,00 %	15.01.2028	403.575	0,09
200.000	Altice Financing SA**	5,75 %	15.08.2029	157.688	0,03
300.000	America Movil SAB de CV*	4,70 %	21.07.2032	288.333	0,06
400.000	America Movil SAB de CV**	5,38 %	04.04.2032	361.578	0,08
400.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,38 %	01.11.2028	349.432	0,07
510.000	Antofagasta Plc*	5,63 %	13.05.2032	500.843	0,11

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
400.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63 %	07.10.2026	364.151	0,08
200.000	Azul Investments LLP**	7,25 %	15.06.2026	122.250	0,03
400.000	Banco Bradesco SA**	4,38 %	18.03.2027	384.168	0,08
435.000	Banco Davivienda SA**	6,65 %	29.12.2049	336.038	0,07
531.000	Banco de Credito del Peru SA**	3,13 %	01.07.2030	482.100	0,10
300.000	Banco do Brasil SA*	6,25 %	29.12.2049	269.940	0,06
600.000	Banco do Brasil SA**	9,00 %	29.12.2049	601.269	0,13
700.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,63 %	29.12.2049	656.857	0,14
450.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand**	5,38 %	17.04.2025	446.265	0,09
800.000	Bancolombia SA*	4,63 %	18.12.2029	704.436	0,15
1.000.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	837.826	0,18
402.000	Bangkok Bank PCL*	4,30 %	15.06.2027	387.455	0,08
500.000	Bank Leumi Le-Israel BM*	3,28 %	29.01.2031	444.802	0,09
300.000	Bank Muscat SAOG*	4,75 %	17.03.2026	286.755	0,06
418.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	3,75 %	30.03.2026	388.484	0,08
1.708.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70 %	22.10.2031	1.462.897	0,31
289.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00 %	27.07.2027	273.084	0,06
500.000	Becle SAB de CV**	2,50 %	14.10.2031	389.223	0,08
400.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	361.448	0,08
1.000.000	BOC Aviation Ltd*	3,00 %	11.09.2029	867.584	0,18
274.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	18.09.2027	251.980	0,05
400.000	Braskem Idesa SAPI*	7,45 %	15.11.2029	316.437	0,07
465.000	Braskem Netherlands Finance BV**	8,50 %	23.01.2081	451.305	0,10
1.528.200	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais <sup>1</sup>	5,33 %	15.02.2028	1.493.731	0,32
865.000	BSF Finance*	5,50 %	23.11.2027	876.210	0,19
800.000	C&W Senior Financing DAC**	6,88 %	15.09.2027	745.744	0,16
200.000	CA Magnum Holdings**	5,38 %	31.10.2026	182.746	0,04
263.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	232.693	0,05
500.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	15.09.2025	458.102	0,10
639.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	12.05.2026	576.335	0,12
300.000	CDBL Funding 2*	2,00 %	04.03.2026	272.907	0,06
600.000	Celestial Miles Ltd*	5,75 %	29.12.2049	576.000	0,12
300.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA**	4,25 %	30.04.2029	281.564	0,06
200.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	185.057	0,04
450.000	Cemex SAB de CV**	7,38 %	05.06.2027	462.546	0,10
800.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	758.376	0,16
645.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	602.582	0,13
275.000	Central Plaza Development Ltd*	5,75 %	29.12.2049	215.876	0,05
300.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd*	4,75 %	08.02.2028	285.301	0,06
300.000	China Construction Bank Corp*	2,45 %	24.06.2030	281.344	0,06
400.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	371.725	0,08

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
300.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd*	5,95 %	08.05.2024	298.985	0,06
500.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95 %	20.10.2025	132.184	0,03
400.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	363.353	0,08
669.000	Comision Federal de Electricidad*	3,35 %	09.02.2031	525.232	0,11
664.000	Comision Federal de Electricidad*	4,69 %	15.05.2029	590.196	0,13
275.000	Comision Federal de Electricidad*	6,26 %	15.02.2052	217.925	0,05
800.000	Commercial Bank PSQC*	4,50 %	29.12.2049	720.432	0,15
531.000	Compania Cervecerias Unidas SA**	3,35 %	19.01.2032	448.623	0,10
449.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	385.622	0,08
387.000	Continuum Energy Levanter Pte Ltd*	4,50 %	09.02.2027	347.829	0,07
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,00 %	30.09.2029	175.056	0,04
454.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,70 %	30.01.2050	339.683	0,07
281.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	4,38 %	05.02.2049	238.891	0,05
300.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	4,80 %	06.08.2030	160.317	0,03
900.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	713.943	0,15
600.000	CT Trust**	5,13 %	03.02.2032	527.722	0,11
600.000	DBS Group Holdings Ltd*	4,52 %	11.12.2028	593.910	0,13
895.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95 %	16.01.2026	838.849	0,18
692.000	DIB Sukuk Ltd*	5,49 %	30.11.2027	705.540	0,15
497.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd*	6,25 %	29.12.2049	498.180	0,11
200.000	DP World Crescent Ltd*	3,88 %	18.07.2029	187.477	0,04
990.000	DP World Ltd*	6,85 %	02.07.2037	1.055.461	0,22
726.000	Ecopetrol SA*	5,88 %	28.05.2045	507.114	0,11
700.000	Ecopetrol SA*	6,88 %	29.04.2030	636.382	0,14
596.000	EI Sukuk Co Ltd*	1,83 %	23.09.2025	547.718	0,12
300.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	4,39 %	30.11.2046	231.249	0,05
550.000	Elect Global Investments Ltd*	4,10 %	29.12.2049	476.658	0,10
300.000	Emaar Sukuk Ltd*	3,64 %	15.09.2026	286.427	0,06
250.000	Embraer Netherlands Finance BV*	6,95 %	17.01.2028	250.430	0,05
800.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	790.514	0,17
550.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado*	3,07 %	18.08.2050	345.894	0,07
941.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13 %	02.05.2049	759.810	0,16
362.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,45 %	16.09.2031	305.686	0,07
440.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,75 %	05.08.2026	413.521	0,09
206.000	Empresa Nacional del Petroleo**	4,50 %	14.09.2047	158.212	0,03
700.000	Endeavour Mining Plc*	5,00 %	14.10.2026	602.910	0,13
403.425	Energean Israel Finance Ltd*	4,88 %	30.03.2026	372.038	0,08
200.000	Energean Israel Finance Ltd*	5,88 %	30.03.2031	175.375	0,04
400.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	348.898	0,07
516.000	Equate Petrochemical BV*	2,63 %	28.04.2028	450.805	0,10
409.000	Falabella SA**	3,38 %	15.01.2032	327.592	0,07

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.200.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	15.10.2027	1.128.340	0,24
400.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	390.160	0,08
700.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	557.625	0,12
550.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	553.168	0,12
450.000	FWD Group Ltd*	5,75 %	09.07.2024	431.734	0,09
902.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	728.425	0,15
773.224	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94 %	30.09.2040	624.202	0,13
433.000	GC Treasury Center Co Ltd*	2,98 %	18.03.2031	350.308	0,07
800.000	GC Treasury Center Co Ltd*	4,40 %	30.03.2032	710.708	0,15
324.000	GCC SAB de CV**	3,61 %	20.04.2032	270.113	0,06
800.000	GENM Capital Labuan Ltd*	3,88 %	19.04.2031	596.322	0,13
900.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	807.750	0,17
441.000	Gohl Capital Ltd*	4,25 %	24.01.2027	403.863	0,09
532.000	Gol Finance SA*	7,00 %	31.01.2025	236.299	0,05
422.110	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	367.214	0,08
477.301	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	400.850	0,09
550.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	447.177	0,10
800.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA*	5,50 %	29.04.2026	773.304	0,16
200.000	Grupo Televisa SAB*	6,63 %	15.01.2040	205.897	0,04
182.114	Guara Norte Sarl**	5,20 %	15.06.2034	154.355	0,03
600.000	HDFC Bank Ltd*	3,70 %	29.12.2049	516.300	0,11
300.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	284.645	0,06
437.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38 %	01.06.2028	417.310	0,09
557.000	Hyundai Capital America**	2,75 %	27.09.2026	498.625	0,11
700.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	618.584	0,13
400.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,54 %	27.04.2032	330.126	0,07
400.000	InRetail Consumer**	3,25 %	22.03.2028	344.512	0,07
320.000	Israel Electric Corp Ltd**	3,75 %	22.02.2032	281.235	0,06
460.000	Israel Electric Corp Ltd*	4,25 %	14.08.2028	434.987	0,09
600.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc**	3,63 %	15.01.2032	486.867	0,10
200.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc**	5,75 %	01.04.2033	191.256	0,04
900.000	JMH Co Ltd*	2,50 %	09.04.2031	734.340	0,16
300.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	237.984	0,05
550.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	506.648	0,11
500.000	KazMunayGas National Co JSC*	3,50 %	14.04.2033	373.442	0,08
600.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38 %	24.04.2030	540.263	0,11
2.087.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75 %	19.04.2047	1.627.942	0,35
200.000	Klabin Austria GmbH**	3,20 %	12.01.2031	160.260	0,03
900.000	Kookmin Bank*	2,50 %	04.11.2030	718.245	0,15
600.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	512.448	0,11
854.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40 %	29.12.2049	760.060	0,16

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
500.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	397.295	0,08
606.985	Leviathan Bond Ltd*	6,50 %	30.06.2027	589.286	0,13
300.000	Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA*	4,38 %	18.06.2026	251.522	0,05
200.000	Longfor Group Holdings Ltd*	3,95 %	16.09.2029	147.238	0,03
700.000	MAF Global Securities Ltd*	7,88 %	29.12.2049	709.198	0,15
950.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	735.343	0,16
400.000	Mashreqbank PSC*	4,25 %	26.02.2024	393.483	0,08
560.000	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	462.872	0,10
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	5,50 %	28.04.2033	211.867	0,05
400.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38 %	30.01.2027	362.237	0,08
500.000	Medco Oak Tree Pte Ltd*	7,38 %	14.05.2026	476.875	0,10
400.000	MEGlobal Canada ULC*	5,00 %	18.05.2025	393.852	0,08
500.000	MEGlobal Canada ULC*	5,88 %	18.05.2030	504.336	0,11
260.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	200.749	0,04
400.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	343.696	0,07
500.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75 %	21.07.2028	418.860	0,09
885.000	Mexico City Airport Trust*	5,50 %	31.07.2047	683.525	0,15
325.000	MGM China Holdings Ltd**	4,75 %	01.02.2027	287.931	0,06
540.000	Millicom International Cellular SA*	5,13 %	15.01.2028	503.088	0,11
180.000	Millicom International Cellular SA*	6,25 %	25.03.2029	172.418	0,04
700.000	Minera Mexico SA de CV**	4,50 %	26.01.2050	529.743	0,11
800.000	Minsur SA**	4,50 %	28.10.2031	696.156	0,15
575.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd*	3,08 %	07.04.2031	506.719	0,11
525.000	MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA**	6,88 %	01.02.2025	356.533	0,08
550.000	MTR Corp Ltd*	1,63 %	19.08.2030	436.330	0,09
376.004	MV24 Capital BV*	6,75 %	01.06.2034	344.245	0,07
368.033	Nakilat Inc**	6,07 %	31.12.2033	380.276	0,08
300.000	Nanyang Commercial Bank Ltd*	3,80 %	20.11.2029	283.296	0,06
700.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50 %	29.12.2049	644.540	0,14
600.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	562.728	0,12
1.000.000	NWD MTN Ltd*	4,13 %	18.07.2029	812.659	0,17
320.000	Oil & Gas Holding Co BSCC**	7,50 %	25.10.2027	328.053	0,07
670.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	8,38 %	07.11.2028	706.079	0,15
300.000	Oil India Ltd*	5,13 %	04.02.2029	285.973	0,06
545.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63 %	08.04.2031	469.643	0,10
600.000	Orbia Advance Corp SAB de CV**	6,75 %	19.09.2042	584.330	0,12
300.000	Oryx Funding Ltd*	5,80 %	03.02.2031	287.208	0,06
800.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83 %	10.09.2030	718.628	0,15
396.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,25 %	19.06.2024	391.418	0,08
394.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,60 %	15.06.2032	378.240	0,08
800.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	805.028	0,17



## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
600.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	562.348	0,12
339.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,38 %	05.02.2050	254.633	0,05
510.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,25 %	15.05.2047	431.218	0,09
1.230.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	6,15 %	21.05.2048	1.170.622	0,25
704.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50 %	10.06.2051	540.719	0,12
90.000	Petrobras Global Finance BV*	6,85 %	05.06.2115	75.906	0,02
300.000	Petrofac Ltd**	9,75 %	15.11.2026	169.926	0,04
7.391.600	Petroleos de Venezuela SA*	5,38 %	12.04.2027	360.341	0,08
1.580.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,50 %	12.04.2037	77.081	0,02
13.366.824	Petroleos de Venezuela SA*	6,00 %	16.05.2024	685.050	0,15
12.004.188	Petroleos de Venezuela SA**	6,00 %	15.11.2026	585.204	0,12
723.000	Petroleos del Peru SA*	4,75 %	19.06.2032	560.108	0,12
1.870.000	Petroleos del Peru SA*	5,63 %	19.06.2047	1.226.393	0,26
1.254.000	Petroleos Mexicanos*	5,95 %	28.01.2031	951.953	0,20
4.474.000	Petroleos Mexicanos*	7,69 %	23.01.2050	3.105.778	0,66
500.000	Petrorio Luxembourg Trading Sarl**	6,13 %	09.06.2026	476.490	0,10
600.000	Prosus NV*	3,83 %	08.02.2051	364.585	0,08
550.000	Prudential Plc*	2,95 %	03.11.2033	451.046	0,10
263.000	QatarEnergy Trading LLC*	3,30 %	12.07.2051	194.904	0,04
825.000	QNB Finance Ltd*	2,63 %	12.05.2025	780.924	0,17
700.000	REC Ltd*	2,25 %	01.09.2026	618.606	0,13
600.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50 %	22.01.2030	521.100	0,11
475.000	Reliance Industries Ltd*	2,88 %	12.01.2032	385.542	0,08
359.000	Reliance Industries Ltd*	3,63 %	12.01.2052	236.261	0,05
580.000	SA Global Sukuk Ltd*	2,69 %	17.06.2031	496.856	0,11
500.000	SABIC Capital I BV*	2,15 %	14.09.2030	422.869	0,09
295.000	Sagcor Financial Co Ltd**	5,30 %	13.05.2028	276.790	0,06
360.000	Sands China Ltd**	4,30 %	08.01.2026	332.694	0,07
497.000	Sands China Ltd*	5,63 %	08.08.2025	475.824	0,10
700.000	Sands China Ltd*	5,90 %	08.08.2028	656.364	0,14
400.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88 %	27.03.2024	392.298	0,08
800.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	728.075	0,15
1.485.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,25 %	16.04.2039	1.332.568	0,28
1.095.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,38 %	16.04.2049	944.527	0,20
484.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,72 %	27.09.2028	489.434	0,10
600.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	483.012	0,10
713.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	3,13 %	17.11.2031	597.034	0,13
200.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*	2,38 %	13.07.2030	166.881	0,04
300.000	Shanghai Port Group BVI Development Co Ltd*	2,85 %	11.09.2029	262.487	0,06
484.000	Shelf Drilling Holdings Ltd**	8,25 %	15.02.2025	420.802	0,09
1.298.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,38 %	13.04.2032	1.159.716	0,25

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
909.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	5,88 %	29.12.2049	899.910	0,19
300.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	288.951	0,06
500.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	393.027	0,08
600.000	Simpar Europe SA**	5,20 %	26.01.2031	455.298	0,10
500.000	Singapore Airlines Ltd*	3,38 %	19.01.2029	448.165	0,10
300.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*	2,70 %	13.01.2025	173.314	0,04
400.000	SNB Funding Ltd*	2,75 %	02.10.2024	382.944	0,08
400.000	SNB Sukuk Ltd*	2,34 %	19.01.2027	363.764	0,08
600.000	Southern Copper Corp*	6,75 %	16.04.2040	671.183	0,14
2.931.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88 %	24.03.2026	3.018.795	0,64
2.026.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	6,95 %	18.03.2030	2.093.288	0,44
800.000	Stillwater Mining Co*	4,00 %	16.11.2026	707.477	0,15
300.000	StoneCo Ltd**	3,95 %	16.06.2028	239.793	0,05
300.000	Studio City Finance Ltd*	6,00 %	15.07.2025	260.581	0,06
300.000	Studio City Finance Ltd*	6,50 %	15.01.2028	233.430	0,05
400.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd*	3,75 %	25.02.2029	364.092	0,08
604.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	603.955	0,13
400.000	Telecom Argentina SA**	8,00 %	18.07.2026	379.023	0,08
400.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	360.010	0,08
700.000	Telefonica Celular del Paraguay SA**	5,88 %	15.04.2027	678.804	0,14
400.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	253.625	0,05
600.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25 %	15.08.2030	429.318	0,09
1.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	3,15 %	01.10.2026	876.530	0,19
1.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,10 %	01.10.2046	613.600	0,13
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,13 %	31.01.2025	199.204	0,04
1.034.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	643.675	0,14
750.000	TNB Global Ventures Capital Bhd*	4,85 %	01.11.2028	729.114	0,16
200.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	156.659	0,03
566.000	Transportadora de Gas del Sur SA*	6,75 %	02.05.2025	523.737	0,11
500.000	Trust Fibra Uno**	5,25 %	15.12.2024	493.725	0,11
200.000	TSMC Arizona Corp*	2,50 %	25.10.2031	164.198	0,03
1.000.000	TSMC Arizona Corp*	4,25 %	22.04.2032	969.950	0,21
400.000	Turk Telekomunikasyon AS*	4,88 %	19.06.2024	377.655	0,08
400.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	347.727	0,07
400.000	Turkiye Is Bankasi AS*	6,13 %	25.04.2024	397.550	0,08
300.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50 %	18.10.2024	288.253	0,06
400.000	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*	6,95 %	14.03.2026	391.130	0,08
400.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,50 %	01.10.2026	359.176	0,08
600.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75 %	01.10.2026	597.626	0,13
955.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00 %	14.10.2031	834.697	0,18
428.000	United Overseas Bank Ltd*	3,86 %	07.10.2032	395.074	0,08

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 31,88 % (31. Dezember 2021: 31,60 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
228.000	Vale Overseas Ltd <sup>†</sup>	3,75 %	08.07.2030	199.999	0,04
750.000	Vedanta Resources Finance II Plc <sup>†</sup>	13,88 %	21.01.2024	654.107	0,14
100.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc <sup>†</sup>	6,80 %	22.11.2025	6.115	0,00
1.337.000	VTR Finance NV <sup>**</sup>	6,38 %	15.07.2028	524.726	0,11
1.200.000	Wynn Macau Ltd <sup>†</sup>	5,63 %	26.08.2028	1.027.554	0,22
200.000	XP Inc <sup>**</sup>	3,25 %	01.07.2026	179.994	0,04
563.000	YPF SA <sup>**</sup>	7,00 %	15.12.2047	338.551	0,07
500.000	YPF SA <sup>†</sup>	8,50 %	28.07.2025	420.113	0,09
300.000	YPF SA <sup>**</sup>	9,00 %	30.06.2029	240.251	0,05
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>141.206.810</b>	<b>30,03</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>149.902.253</b>	<b>31,88</b>
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %)</b>					
<b>Chilenischer Peso</b>					
1.320.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos <sup>†</sup>	4,70 %	01.09.2030	1.519.871	0,32
420.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos <sup>†</sup>	5,00 %	01.03.2035	497.273	0,11
5.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos <sup>†</sup>	5,10 %	15.07.2050	6.035	0,00
640.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos <sup>†</sup>	7,00 %	01.05.2034	872.156	0,18
<b>Chilenischer Peso insgesamt</b>				<b>2.895.335</b>	<b>0,61</b>
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
16.000.000	China Government Bond <sup>**</sup>	1,99 %	09.04.2025	2.282.366	0,49
7.000.000	China Government Bond <sup>**</sup>	2,62 %	25.09.2029	996.023	0,21
10.790.000	China Government Bond <sup>**</sup>	2,68 %	21.05.2030	1.537.405	0,33
8.600.000	China Government Bond <sup>**</sup>	2,75 %	15.06.2029	1.233.741	0,26
3.000.000	China Government Bond <sup>**</sup>	2,80 %	24.03.2029	431.839	0,09
8.000.000	China Government Bond <sup>**</sup>	2,91 %	14.10.2028	1.162.832	0,25
5.000.000	China Government Bond <sup>**</sup>	2,94 %	17.10.2024	727.630	0,15
3.000.000	China Government Bond <sup>**</sup>	3,01 %	13.05.2028	438.395	0,09
12.800.000	China Government Bond <sup>**</sup>	3,02 %	22.10.2025	1.873.284	0,40
4.000.000	China Government Bond <sup>**</sup>	3,02 %	27.05.2031	583.575	0,12
9.700.000	China Government Bond <sup>**</sup>	3,13 %	21.11.2029	1.432.918	0,31
6.200.000	China Government Bond <sup>**</sup>	3,27 %	19.11.2030	924.297	0,20
3.650.000	China Government Bond <sup>**</sup>	3,72 %	12.04.2051	569.229	0,12
7.800.000	China Government Bond <sup>**</sup>	3,81 %	14.09.2050	1.234.000	0,26
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>				<b>15.427.534</b>	<b>3,28</b>
<b>Kolumbianischer Peso</b>					
5.936.893.459	Colombian TES <sup>†</sup>	2,25 %	18.04.2029	1.007.262	0,21
19.214.400.000	Colombian TES <sup>†</sup>	5,75 %	03.11.2027	3.005.822	0,64
32.804.500.000	Colombian TES <sup>†</sup>	6,00 %	28.04.2028	5.063.212	1,08

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Kolumbianischer Peso (Fortsetzung)</b>					
7.416.400.000	Colombian TES*	7,00 %	26.03.2031	1.083.343	0,23
2.356.900.000	Colombian TES Series G*	7,00 %	26.03.2031	344.282	0,07
5.785.500.000	Colombian TES*	7,00 %	30.06.2032	814.090	0,17
3.417.700.000	Colombian TES*	7,25 %	18.10.2034	465.893	0,10
5.092.800.000	Colombian TES*	9,25 %	28.05.2042	761.250	0,16
171.000.000	Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter*	7,88 %	12.08.2024	32.091	0,01
<b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>				<b>12.577.245</b>	<b>2,67</b>
<b>Tschechische Krone</b>					
42.650.000	Czech Republic Government Bond*	0,05 %	29.11.2029	1.341.396	0,29
16.760.000	Czech Republic Government Bond*	0,25 %	10.02.2027	607.801	0,13
104.310.000	Czech Republic Government Bond*	1,00 %	26.06.2026	3.998.138	0,85
30.630.000	Czech Republic Government Bond*	1,20 %	13.03.2031	1.007.534	0,21
30.900.000	Czech Republic Government Bond*	2,00 %	13.10.2033	1.029.754	0,22
11.940.000	Czech Republic Government Bond*	2,50 %	25.08.2028	459.120	0,10
56.980.000	Czech Republic Government Bond*	2,75 %	23.07.2029	2.183.155	0,46
16.820.000	Czech Republic Government Bond*	4,20 %	04.12.2036	688.416	0,15
<b>Tschechische Krone insgesamt</b>				<b>11.315.314</b>	<b>2,41</b>
<b>Peso Dominikanische Republik</b>					
36.550.000	Dominican Republic International Bond*	9,75 %	05.06.2026	624.770	0,13
<b>Peso Dominikanische Republik insgesamt</b>				<b>624.770</b>	<b>0,13</b>
<b>Euro</b>					
166.000	Benin Government International Bond*	4,88 %	19.01.2032	138.235	0,03
413.000	Benin Government International Bond*	4,95 %	22.01.2035	322.303	0,07
136.000	Benin Government International Bond*	6,88 %	19.01.2052	105.934	0,02
1.740.000	Egypt Government International Bond*	6,38 %	11.04.2031	1.296.148	0,28
201.000	Hungary Government International Bond*	1,75 %	05.06.2035	141.635	0,03
468.000	Indonesia Government International Bond*	1,30 %	23.03.2034	362.193	0,08
922.000	Indonesia Government International Bond*	1,40 %	30.10.2031	771.142	0,16
590.000	Indonesia Government International Bond*	3,75 %	14.06.2028	614.674	0,13
2.643.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,63 %	22.03.2048	2.004.522	0,43
1.920.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88 %	17.10.2040	1.557.302	0,33
500.000	Kazakhstan Government International Bond*	1,50 %	30.09.2034	397.534	0,08
2.145.000	Peruvian Government International Bond*	1,25 %	11.03.2033	1.602.001	0,34
1.185.000	Peruvian Government International Bond*	1,95 %	17.11.2036	875.476	0,19
400.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	294.687	0,06
987.877	Provincia de Buenos Aires*	4,00 %	01.09.2037	328.175	0,07
615.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95 %	07.07.2032	489.368	0,10
750.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	537.611	0,11

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
238.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	14.04.2033	163.727	0,04
186.000	Romanian Government International Bond*	2,63 %	02.12.2040	111.630	0,02
322.000	Romanian Government International Bond*	2,88 %	13.04.2042	194.100	0,04
2.816.000	Romanian Government International Bond*	3,38 %	28.01.2050	1.746.380	0,37
1.156.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	925.579	0,20
100.000	Romanian Government International Bond*	4,63 %	03.04.2049	78.305	0,02
807.000	Serbia International Bond*	1,50 %	26.06.2029	620.122	0,13
466.000	Serbia International Bond*	1,65 %	03.03.2033	303.572	0,07
972.000	Serbia International Bond*	2,05 %	23.09.2036	589.130	0,13
412.000	Serbia International Bond*	3,13 %	15.05.2027	379.692	0,08
688.000	Tunisian Republic*	5,63 %	17.02.2024	578.773	0,12
417.000	Tunisian Republic*	6,38 %	15.07.2026	281.993	0,06
229.000	Ukraine Government International Bond**	6,75 %	20.06.2028	45.318	0,01
<b>Euro insgesamt</b>				<b>17.857.261</b>	<b>3,80</b>
<b>Ghanaischer Cedi</b>					
9.799.000	Republic of Ghana Government Bonds*	19,25 %	18.12.2023	815.776	0,17
<b>Ghanaischer Cedi insgesamt</b>				<b>815.776</b>	<b>0,17</b>
<b>Ungarischer Forint</b>					
297.370.000	Hungary Government Bond*	4,50 %	23.03.2028	616.714	0,13
<b>Ungarischer Forint insgesamt</b>				<b>616.714</b>	<b>0,13</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>					
8.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,25 %	15.06.2036	482.136	0,10
45.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.08.2028	2.866.274	0,61
2.100.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	129.939	0,03
1.800.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.07.2037	111.524	0,02
37.883.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.05.2033	2.369.448	0,50
12.300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.05.2027	810.547	0,17
10.400.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	669.512	0,14
17.300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2042	1.115.241	0,24
3.500.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2043	225.316	0,05
16.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.08.2032	1.064.639	0,23
16.920.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.06.2035	1.121.408	0,24
13.390.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.04.2040	885.713	0,19
54.376.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,13 %	15.05.2024	3.604.905	0,77
3.824.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2029	264.753	0,06
23.241.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2036	1.629.913	0,35
19.584.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2024	1.299.799	0,28
38.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.09.2026	2.611.827	0,55

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>					
917.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2034	64.571	0,01
17.761.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,75 %	15.05.2031	1.273.322	0,27
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>				<b>22.600.787</b>	<b>4,81</b>
<b>Malaysischer Ringgit</b>					
5.700.000	Malaysia Government Bond**	2,63 %	15.04.2031	1.167.225	0,25
3.000.000	Malaysia Government Bond**	3,58 %	15.07.2032	653.842	0,14
8.600.000	Malaysia Government Bond**	3,73 %	15.06.2028	1.929.305	0,41
3.600.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	22.05.2040	755.637	0,16
11.200.000	Malaysia Government Bond**	3,80 %	17.08.2023	2.546.072	0,54
4.780.000	Malaysia Government Bond**	3,83 %	05.07.2034	1.051.486	0,22
3.300.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	30.11.2026	751.009	0,16
10.500.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	16.11.2027	2.387.281	0,51
1.800.000	Malaysia Government Bond**	3,91 %	15.07.2026	410.127	0,09
6.925.000	Malaysia Government Bond**	4,06 %	30.09.2024	1.580.622	0,34
5.200.000	Malaysia Government Bond**	4,07 %	15.06.2050	1.076.752	0,23
3.910.000	Malaysia Government Bond**	4,25 %	31.05.2035	891.644	0,19
3.530.000	Malaysia Government Bond**	4,64 %	07.11.2033	835.834	0,18
3.400.000	Malaysia Government Bond**	4,70 %	15.10.2042	803.332	0,17
2.100.000	Malaysia Government Bond**	4,76 %	07.04.2037	501.298	0,11
990.000	Malaysia Government Bond**	4,89 %	08.06.2038	239.329	0,05
2.400.000	Malaysia Government Bond**	4,94 %	30.09.2043	579.317	0,12
15.000.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,07 %	30.09.2026	3.426.862	0,73
5.000.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,37 %	31.10.2028	1.157.362	0,24
<b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>				<b>22.744.336</b>	<b>4,84</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
22.713.100	Mexican Bonos*	5,00 %	06.03.2025	1.057.585	0,22
54.377.400	Mexican Bonos*	7,50 %	03.06.2027	2.632.863	0,56
189.624.600	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	9.011.991	1,92
46.150.000	Mexican Bonos*	7,75 %	13.11.2042	2.068.754	0,44
4.130.800	Mexican Bonos*	8,00 %	07.11.2047	189.196	0,04
64.250.000	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	3.209.030	0,68
72.292.000	Mexican Bonos*	8,50 %	18.11.2038	3.513.575	0,75
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>21.682.994</b>	<b>4,61</b>
<b>Peruanischer Sol</b>					
12.864.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	7,00 %	14.02.2024	3.297.380	0,70
2.110.000	Peru Government Bond*	5,35 %	12.08.2040	411.599	0,09
2.604.000	Peru Government Bond*	5,40 %	12.08.2034	546.814	0,12
6.877.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	1.585.136	0,34

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Peruanischer Sol (Fortsetzung)</b>					
2.542.000	Peruvian Government International Bond**	5,20 %	12.09.2023	660.303	0,14
3.153.000	Peruvian Government International Bond*	5,40 %	12.08.2034	662.098	0,14
2.429.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	570.342	0,12
60.000	Peruvian Government International Bond**	8,20 %	12.08.2026	16.467	0,00
<b>Peruanischer Sol insgesamt</b>				<b>7.750.139</b>	<b>1,65</b>
<b>Polnischer Zloty</b>					
15.854.000	Republic of Poland Government Bond*	0,25 %	25.10.2026	2.828.834	0,60
11.699.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25 %	25.10.2030	1.794.846	0,38
56.251.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2026	11.075.434	2,36
10.692.000	Republic of Poland Government Bond**	2,75 %	25.04.2028	2.003.683	0,43
26.414.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75 %	25.10.2029	4.733.142	1,01
9.216.000	Republic of Poland Government Bond*	3,75 %	25.05.2027	1.854.420	0,39
<b>Polnischer Zloty insgesamt</b>				<b>24.290.359</b>	<b>5,17</b>
<b>Rumänischer neuer Leu</b>					
20.775.000	Romania Government Bond*	2,50 %	25.10.2027	3.578.376	0,76
7.120.000	Romania Government Bond*	3,65 %	24.09.2031	1.147.404	0,24
5.250.000	Romania Government Bond*	4,75 %	11.10.2034	826.424	0,18
4.580.000	Romania Government Bond*	4,85 %	25.07.2029	832.136	0,18
7.650.000	Romania Government Bond*	5,00 %	12.02.2029	1.426.885	0,30
1.500.000	Romania Government Bond*	6,70 %	25.02.2032	296.234	0,06
3.355.000	Romania Government Bond*	8,25 %	29.09.2032	729.994	0,16
<b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>				<b>8.837.453</b>	<b>1,88</b>
<b>Serbischer Dinar</b>					
15.020.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	11.01.2026	129.299	0,03
15.760.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	20.08.2032	119.420	0,03
71.430.000	Serbia Treasury Bonds*	5,88 %	08.02.2028	624.818	0,13
<b>Serbischer Dinar insgesamt</b>				<b>873.537</b>	<b>0,19</b>
<b>Südafrikanischer Rand</b>					
72.402.163	Republic of South Africa Government Bond*	7,00 %	28.02.2031	3.437.592	0,73
290.203.259	Republic of South Africa Government Bond*	8,50 %	31.01.2037	13.563.465	2,88
23.154.690	Republic of South Africa Government Bond*	8,75 %	31.01.2044	1.062.613	0,23
125.761.234	Republic of South Africa Government Bond*	8,88 %	28.02.2035	6.234.888	1,33
27.668.185	Republic of South Africa Government Bond*	9,00 %	31.01.2040	1.318.836	0,28
26.427.855	Republic of South Africa Government Bond*	10,50 %	21.12.2026	1.644.891	0,35
<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>				<b>27.262.285</b>	<b>5,80</b>

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Thailändischer Baht</b>					
22.000.000	Thailand Government Bond**	1,00 %	17.06.2027	610.485	0,13
150.162.000	Thailand Government Bond**	1,45 %	17.12.2024	4.320.468	0,92
3.425.000	Thailand Government Bond*	1,59 %	17.12.2035	84.106	0,02
10.000.000	Thailand Government Bond**	1,60 %	17.06.2035	248.733	0,05
98.000.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.12.2031	2.721.550	0,58
26.000.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.06.2042	606.214	0,13
64.618.000	Thailand Government Bond**	2,40 %	17.12.2023	1.887.906	0,40
74.000.000	Thailand Government Bond**	2,65 %	17.06.2028	2.206.606	0,47
8.831.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.06.2046	226.191	0,05
65.284.000	Thailand Government Bond**	3,30 %	17.06.2038	1.902.733	0,41
68.278.000	Thailand Government Bond**	3,40 %	17.06.2036	2.046.970	0,44
632.000	Thailand Government Bond**	3,63 %	16.06.2023	18.452	0,00
125.000	Thailand Government Bond**	3,65 %	20.06.2031	3.935	0,00
43.380.000	Thailand Government Bond**	3,78 %	25.06.2032	1.375.182	0,29
67.595.000	Thailand Government Bond**	4,88 %	22.06.2029	2.270.008	0,48
<b>Thailändischer Baht insgesamt</b>				<b>20.529.539</b>	<b>4,37</b>
<b>Türkische Lira</b>					
44.477.549	Turkey Government Bond*	1,50 %	18.06.2025	3.313.333	0,70
<b>Türkische Lira insgesamt</b>				<b>3.313.333</b>	<b>0,70</b>
<b>Uganda-Schilling</b>					
4.469.700.000	Republic of Uganda Government Bonds*	14,25 %	22.06.2034	1.090.644	0,23
<b>Uganda-Schilling insgesamt</b>				<b>1.090.644</b>	<b>0,23</b>
<b>US-Dollar</b>					
831.000	Angolan Government International Bond*	8,75 %	14.04.2032	722.595	0,15
2.852.000	Angolan Government International Bond*	9,38 %	08.05.2048	2.267.879	0,48
3.260.488	Argentine Republic Government International Bond*	0,50 %	09.07.2030	887.471	0,19
9.130.000	Argentine Republic Government International Bond*	1,50 %	09.07.2035	2.338.610	0,50
690.000	Bahamas Government International Bond*	6,00 %	21.11.2028	533.525	0,11
398.000	Bermuda Government International Bond*	2,38 %	20.08.2030	337.718	0,07
484.000	Bermuda Government International Bond*	4,75 %	15.02.2029	482.900	0,11
499.000	Bermuda Government International Bond*	5,00 %	15.07.2032	496.587	0,11
1.356.000	Brazilian Government International Bond*	5,00 %	27.01.2045	1.009.070	0,21
290.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	07.01.2041	246.333	0,05
200.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	21.02.2047	159.115	0,03
417.000	Chile Government International Bond*	3,25 %	21.09.2071	258.275	0,06
250.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	191.960	0,04
2.050.000	Colombia Government International Bond*	5,00 %	15.06.2045	1.402.315	0,30



## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.823.000	Colombia Government International Bond*	5,20 %	15.05.2049	1.933.292	0,41
460.000	Colombia Government International Bond*	6,13 %	18.01.2041	367.437	0,08
425.000	Colombia Government International Bond*	8,00 %	20.04.2033	426.805	0,09
561.000	Corp Financiera de Desarrollo SA*	5,25 %	15.07.2029	538.164	0,11
383.000	Costa Rica Government International Bond*	7,00 %	04.04.2044	362.002	0,08
162.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16 %	12.03.2045	155.515	0,03
1.145.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25 %	23.10.2023	1.027.866	0,22
2.494.000	Dominican Republic International Bond*	5,88 %	30.01.2060	1.838.530	0,40
1.311.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	22.02.2033	1.187.506	0,25
314.000	Dominican Republic International Bond*	6,40 %	05.06.2049	254.989	0,05
219.000	Dominican Republic International Bond*	6,50 %	15.02.2048	181.231	0,04
387.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	337.401	0,07
219.844	Ecuador Government International Bond*	0,00 %	31.07.2030	86.961	0,02
1.886.446	Ecuador Government International Bond*	1,50 %	31.07.2040	776.898	0,17
4.309.917	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2035	2.002.982	0,43
1.307.922	Ecuador Government International Bond*	5,50 %	31.07.2030	846.969	0,18
590.000	Egypt Government International Bond*	8,15 %	20.11.2059	387.779	0,08
3.500.000	Egypt Government International Bond*	8,70 %	01.03.2049	2.345.784	0,50
1.860.000	Egypt Government International Bond*	8,88 %	29.05.2050	1.264.095	0,27
1.019.000	El Salvador Government International Bond*	7,12 %	20.01.2050	403.408	0,09
3.513.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	1.571.507	0,33
494.000	Ghana Government International Bond*	8,63 %	07.04.2034	181.372	0,04
311.000	Ghana Government International Bond*	8,95 %	26.03.2051	111.378	0,02
3.159.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	2.238.783	0,48
933.000	Guatemala Government Bond*	3,70 %	07.10.2033	772.714	0,16
200.000	Guatemala Government Bond*	6,13 %	01.06.2050	188.953	0,04
551.000	Honduras Government International Bond*	5,63 %	24.06.2030	444.432	0,09
351.000	Honduras Government International Bond*	6,25 %	19.01.2027	310.571	0,07
1.690.000	Indonesia Government International Bond*	8,50 %	12.10.2035	2.147.932	0,46
659.313	Iraq International Bond*	5,80 %	15.01.2028	609.700	0,13
1.235.000	Lebanon Government International Bond*	6,38 %	01.01.2025	76.150	0,02
3.089.000	Lebanon Government International Bond*	6,60 %	27.11.2026	189.127	0,04
878.000	Lebanon Government International Bond*	6,65 %	26.02.2030	53.602	0,01
965.000	Lebanon Government International Bond*	6,85 %	25.05.2029	59.106	0,01
7.131.000	Lebanon Government International Bond*	8,25 %	17.05.2034	442.158	0,09
2.220.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	1.876.132	0,40
401.000	Mongolia Government International Bond*	3,50 %	07.07.2027	323.850	0,07
400.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	346.029	0,07
1.303.000	Mongolia Government International Bond*	8,75 %	09.03.2024	1.263.916	0,27
260.000	Morocco Government International Bond*	5,50 %	11.12.2042	223.951	0,05
627.000	Nigeria Government International Bond*	7,88 %	16.02.2032	474.601	0,10

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
503.000	Nigeria Government International Bond*	8,75 %	21.01.2031	413.148	0,09
2.430.000	Oman Government International Bond*	6,75 %	17.01.2048	2.286.020	0,49
930.000	Panama Government International Bond*	6,40 %	14.02.2035	946.191	0,20
480.000	Panama Government International Bond*	6,70 %	26.01.2036	502.006	0,11
485.000	Papua New Guinea Government International Bond*	8,38 %	04.10.2028	424.617	0,09
988.000	Paraguay Government International Bond*	5,40 %	30.03.2050	855.060	0,18
463.000	Paraguay Government International Bond*	5,60 %	13.03.2048	405.966	0,09
668.000	Paraguay Government International Bond*	6,10 %	11.08.2044	645.148	0,14
363.163	Provincia de Cordoba*	6,88 %	10.12.2025	294.616	0,06
1.948.000	Qatar Government International Bond*	4,82 %	14.03.2049	1.903.267	0,41
751.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60 %	02.02.2031	600.792	0,13
1.450.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	5,13 %	01.09.2029	1.375.143	0,29
710.000	Republic of Kenya Government International Bond*	8,00 %	22.05.2032	608.903	0,13
361.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,75 %	16.11.2032	385.643	0,08
2.246.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75 %	30.09.2049	1.659.417	0,35
922.000	Republic of South Africa Government International Bond*	7,30 %	20.04.2052	798.498	0,17
200.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	5,38 %	20.02.2029	186.239	0,04
473.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20 %	11.05.2027	150.925	0,03
2.816.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	901.829	0,19
1.075.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,83 %	18.07.2026	344.276	0,07
1.196.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	380.951	0,08
1.913.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	03.11.2025	617.120	0,13
1.129.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55 %	28.03.2030	360.241	0,08
910.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85 %	14.03.2029	291.429	0,06
524.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25 %	24.06.2030	93.634	0,02
393.000	Turkey Government International Bond*	6,50 %	20.09.2033	328.328	0,07
510.000	UAE International Government Bond*	4,95 %	07.07.2052	510.493	0,11
1.921.000	Ukraine Government International Bond*	0,00 %	01.08.2041	566.311	0,12
1.782.000	Ukraine Government International Bond*	6,88 %	21.05.2031	347.490	0,07
529.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	115.917	0,02
636.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2028	137.535	0,03
479.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	104.394	0,02
621.000	Uzbekneftegaz JSC*	4,75 %	16.11.2028	500.178	0,11
7.776.600	Venezuela Government International Bond*	8,25 %	13.10.2024	680.452	0,15
660.000	Zambia Government International Bond*	5,38 %	30.12.2023	279.642	0,06
2.236.000	Zambia Government International Bond*	8,97 %	30.07.2027	1.006.256	0,21
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>63.974.006</b>	<b>13,61</b>
<b>Uruguayischer Peso</b>					
27.497.530	Uruguay Government International Bond*	8,25 %	21.05.2031	600.568	0,13
<b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>				<b>600.568</b>	<b>0,13</b>

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 61,28 % (31. Dezember 2021: 58,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Sambischer Kwacha</b>					
14.749.000	Zambia Government Bond*	13,00 %	25.01.2031	432.664	0,09
<b>Sambischer Kwacha insgesamt</b>				<b>432.664</b>	<b>0,09</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>288.112.593</b>	<b>61,28</b>

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Investmentfonds 2,84 % (31. Dezember 2021: 1,71 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
1.409.964	Neuberger Berman China Bond Fund	13.380.558	2,84
<b>Investmentfonds insgesamt #</b>		<b>13.380.558</b>	<b>2,84</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>451.395.404</b>	<b>96,00</b>

### Devisenterminkontrakte 0,86 % (31. Dezember 2021: 0,59 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
137.302.532 BRL	25.452.318 US\$	01.03.2023	Goldman Sachs International	1	285.200	0,06
13.387.233 BRL	2.506.034 US\$	01.03.2023	Morgan Stanley	1	3.418	0,00
5.009.223.743 CLP	5.623.287 US\$	09.02.2023	Morgan Stanley	1	233.112	0,05
256.504.018 CLP	295.518 US\$	09.02.2023	UBS AG	1	4.366	0,00
21.542.841 CNY	3.097.706 US\$	09.01.2023	Citibank NA	1	17.343	0,00
25.804.931 CNY	3.715.334 US\$	17.01.2023	Goldman Sachs International	1	18.464	0,00
25.798.935 CZK	1.049.219 €	16.03.2023	Citibank NA	1	10.221	0,00
53.255.250 CZK	2.171.595 €	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	27.210	0,01
34.509.646 EGP	1.179.414 US\$	20.03.2023	Goldman Sachs International	1	82.365	0,02
526.472 €	2.616.340 RON	09.02.2023	Citibank NA	1	130	0,00
565.263 €	2.809.565 RON	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	43	0,00
3.486.875 €	3.623.068 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	98.299	0,02
272.922 €	287.976 US\$	05.01.2023	Standard Chartered Bank	1	3.320	0,00
451.464.455 HUF	1.089.967 €	10.01.2023	Barclays Bank Plc	1	36.989	0,01
1.414.400.903 HUF	3.264.518 €	16.03.2023	Citibank NA	1	192.382	0,04
2.611.422.176 HUF	6.255.617 €	23.01.2023	Citibank NA	1	232.168	0,05
1.414.400.904 HUF	3.329.400 €	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	122.797	0,03
112.945.907 HUF	270.932 €	23.01.2023	Goldman Sachs International	1	9.644	0,00
671.214.681 HUF	1.610.593 €	06.01.2023	Goldman Sachs International	1	68.502	0,02
43.987.889.490 IDR	2.820.279 US\$	24.01.2023	Citibank NA	1	26.904	0,01
4.285.090.020 IDR	274.897 US\$	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	702	0,00
1.472.050.793 KRW	1.122.846 US\$	19.01.2023	Deutsche Bank AG	1	47.255	0,01
1.265.361.686 KRW	972.982 US\$	08.02.2023	Goldman Sachs International	1	33.296	0,01
1.567.655.898 KRW	1.141.849 US\$	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	104.828	0,02
12.828.144 MXN	641.129 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	8.758	0,00
10.359.241 MYR	2.299.499 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	52.202	0,01

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,86 % (31. Dezember 2021: 0,59 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
8.531.214 MYR	1.930.052 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	21.919	0,01
1.907.399 PEN	493.199 US\$	16.03.2023	Barclays Bank Plc	1	3.633	0,00
6.590.916 PHP	111.580 US\$	07.02.2023	Citibank NA	1	6.772	0,00
7.639.017 PLN	1.608.326 €	05.01.2023	Citibank NA	1	24.861	0,01
15.052.718 PLN	3.149.905 €	20.01.2023	HSBC Bank Plc	2	61.645	0,01
5.298.647 PLN	1.109.990 €	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	20.412	0,00
5.264.430 PLN	1.103.661 €	20.01.2023	UBS AG	1	19.384	0,00
4.997.645 RON	1.004.025 €	09.02.2023	Barclays Bank Plc	1	1.489	0,00
9.910.455 RON	1.991.828 €	09.02.2023	Goldman Sachs International	2	2.075	0,00
1.349.916 SGD	996.905 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	10.027	0,00
37.062.521 THB	1.076.029 US\$	21.03.2023	Barclays Bank Plc	1	2.112	0,00
79.919.941 THB	2.254.219 US\$	03.01.2023	Deutsche Bank AG	2	53.272	0,01
91.345.418 THB	2.653.839 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	1.679	0,00
12.931.788 THB	373.297 US\$	03.01.2023	Standard Chartered Bank	1	77	0,00
38.557.760 TWD	1.252.852 US\$	03.01.2023	Citibank NA	1	1.651	0,00
2.106.444 US\$	11.116.590 BRL	01.03.2023	Goldman Sachs International	2	22.626	0,01
7.394.048 US\$	35.748.965.995 COP	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	72.557	0,02
237.965 US\$	8.161.904 THB	21.03.2023	HSBC Bank Plc	1	537	0,00
233.032 US\$	218.221 €	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	136	0,00
347.629 US\$	3.302.471 GHS	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	28.055	0,01
1.262.533 US\$	38.557.760 TWD	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	5.207	0,00
416.265 US\$	1.828.027 MYR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.276	0,00
1.857.146 US\$	9.033.382.063 COP	09.02.2023	Morgan Stanley	1	7.084	0,00
15.386.518 ZAR	884.450 US\$	16.03.2023	Morgan Stanley	1	14.341	0,00
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
4.188.153 AUD	2.818.861 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	4	29.569	0,01
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
148.329.976 €	157.212.176 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	12	1.859.088	0,40
24.135 US\$	22.500 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	6	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
963 £	1.160 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
1.827.929 US\$	1.500.941 £	15.03.2023	Westpac Banking Corp	17	19.239	0,00
<i>Abgesicherte Klassen NOK</i>						
113.550 NOK	11.414 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	148	0,00
1.148 NOK	115 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	1	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
256.727 SEK	24.677 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	63	0,00
381.510 US\$	3.939.875 SEK	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	1.851	0,00
1.567 US\$	16.057 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	6	19	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
2.043.071 SGD	1.506.405 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	18.629	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>4.031.358</b>	<b>0,86</b>

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,25 % (31. Dezember 2021: 0,16 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(23)	Euro-BOBL Future March 2023	98.432	0,02
(44)	Euro-Bund Future March 2023	348.777	0,07
(24)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	634.053	0,14
(5)	Euro-Schatz Future March 2023	6.991	0,00
(25)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	23.438	0,01
19	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	5.047	0,00
13	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	203	0,00
(26)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	55.656	0,01
15	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	234	0,00
10	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	2.969	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>1.175.800</b>	<b>0,25</b>

### Zinsswap-Kontrakte 1,03 % (31. Dezember 2021: 0,53 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
BRL	9.000.000	02.01.2023	Goldman Sachs International	(Zahlung)	11,99 %	1D BROIS	871.727	0,19
PLN	52.888.820	25.03.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	1,99 %	6M WIBOR	726.218	0,15
CLP	3.154.502.226	05.06.2030	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	2,33 %	1D CLICP	716.097	0,15
MXN	144.900.054	31.08.2029	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,92 %	28D MXIBTIE	680.128	0,14
COP	21.110.657.012	31.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,14 %	1D COOVIBR	445.813	0,10
MXN	63.783.049	01.01.2032	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,64 %	28D MXIBTIE	218.644	0,05
BRL	9.300.630	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	10,29 %	1D BROIS	180.347	0,04
MXN	40.040.892	10.11.2031	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,38 %	28D MXIBTIE	169.181	0,04
BRL	4.999.220	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,26 %	1D BROIS	167.621	0,04
COP	20.252.351.381	13.04.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	8,37 %	1D COOVIBR	162.308	0,03
MXN	32.171.839	10.11.2031	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,35 %	28D MXIBTIE	138.952	0,03
COP	3.561.060.874	06.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,40 %	1D COOVIBR	92.189	0,02
BRL	1.006.291	02.01.2023	Goldman Sachs International	(Zahlung)	10,84 %	1D BROIS	66.596	0,01
CZK	270.546.474	30.11.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	5,02 %	3M PRIBOR	62.337	0,01
PLN	10.941.780	14.12.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	5,70 %	6M WIBOR	49.917	0,01
COP	1.516.059.531	07.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,45 %	1D COOVIBR	38.712	0,01
COP	3.223.342.325	11.08.2032	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,02 %	1D COOVIBR	29.876	0,01
BRL	19.142.113	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,77 %	1D BROIS	13.414	0,00
BRL	9.439.141	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	12,68 %	1D BROIS	11.008	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten **</b>							<b>4.841.085</b>	<b>1,03</b>

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,35 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
USD	28.350.680	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on CDX.EM.38	1.658.685	0,35
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b>					<b>1.658.685</b>	<b>0,35</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>463.102.332 98,49</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,44 %) (31. Dezember 2021: (0,21 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
8.830.674 BRL	1.689.945 US\$	06.01.2023	Goldman Sachs International	1	(18.127)	(0,01)
8.081.196.526 COP	1.678.686 US\$	06.01.2023	Barclays Bank Plc	1	(12.750)	(0,00)
538.188.911 COP	111.429 US\$	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.206)	(0,00)
1.815.833 €	8.670.525 PLN	20.01.2023	Citibank NA	1	(33.954)	(0,01)
2.903.366 €	13.816.041 PLN	20.01.2023	Goldman Sachs International	2	(43.496)	(0,01)
45.884 €	1.127.548 CZK	30.01.2023	Goldman Sachs International	1	(677)	(0,00)
2.664.583 €	2.845.456 US\$	04.01.2023	Goldman Sachs International	1	(1.681)	(0,00)
8.369.918 €	39.937.457 PLN	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(72.996)	(0,02)
618.278 €	257.739.797 HUF	23.01.2023	Goldman Sachs International	1	(21.988)	(0,01)
238.945 €	99.710.821 HUF	23.01.2023	HSBC Bank Plc	1	(8.769)	(0,00)
318.358 €	1.494.165 PLN	20.01.2023	HSBC Bank Plc	1	(38)	(0,00)
218.221 €	233.032 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(136)	(0,00)
2.169.943 €	898.237.128 HUF	10.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(72.167)	(0,02)
1.162.693 €	5.555.839 PLN	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(22.658)	(0,01)
621.533 €	2.954.717 PLN	16.03.2023	Morgan Stanley	2	(2.938)	(0,00)
213.074 €	5.227.691 CZK	30.01.2023	UBS AG	1	(2.774)	(0,00)
17.495.949.891 IDR	1.132.571 US\$	05.01.2023	Goldman Sachs International	1	(7.305)	(0,00)
22.206.849.579 IDR	1.437.821 US\$	05.01.2023	HSBC Bank Plc	2	(9.570)	(0,00)
11.423.544 ILS	3.347.559 US\$	16.03.2023	Citibank NA	1	(97.167)	(0,02)
3.738.612 ILS	1.102.835 US\$	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(39.071)	(0,01)
1.295.787 PLN	274.453 €	16.03.2023	UBS AG	1	(728)	(0,00)
3.353.980 RON	675.636 €	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	(950)	(0,00)
200.567.410 THB	5.820.581 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(21.948)	(0,01)
12.682.995 THB	368.062 US\$	06.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.805)	(0,00)
38.557.760 TWD	1.256.977 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(2.474)	(0,00)
1.065.591 US\$	37.062.521 THB	03.01.2023	Barclays Bank Plc	1	(4.498)	(0,00)
280.017 US\$	5.558.723 MXN	15.03.2023	Barclays Bank Plc	1	(1.593)	(0,00)

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,44 %) (31. Dezember 2021: (0,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.208.134 US\$	1.202.674 €	20.01.2023	Citibank NA	1	(76.908)	(0,02)
987.419 US\$	31.799.731 TWD	30.01.2023	Citibank NA	1	(49.535)	(0,01)
1.253.067 US\$	38.557.760 TWD	03.01.2023	Citibank NA	1	(1.435)	(0,00)
355.163 US\$	12.322.266 THB	03.01.2023	Citibank NA	1	(612)	(0,00)
2.820.514 US\$	43.987.889.490 IDR	05.01.2023	Citibank NA	1	(8.601)	(0,00)
1.193.728 US\$	18.672.538.712 IDR	15.03.2023	Citibank NA	1	(13.246)	(0,00)
1.481.059 US\$	1.400.775 €	04.01.2023	Citibank NA	2	(13.917)	(0,00)
179.128 US\$	237.389.658 KRW	08.02.2023	Goldman Sachs International	1	(9.656)	(0,00)
367.135 US\$	2.549.942 CNY	17.01.2023	Goldman Sachs International	1	(1.824)	(0,00)
6.146.941 US\$	123.669.843 TRY	15.03.2023	Goldman Sachs International	2	(118.275)	(0,03)
3.361.000 US\$	117.147.649 THB	06.01.2023	Goldman Sachs International	1	(21.963)	(0,01)
833.511 US\$	1.183.961.397 KRW	08.02.2023	HSBC Bank Plc	1	(108.033)	(0,02)
676.727 US\$	2.972.524 MYR	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(5.519)	(0,00)
561.351 US\$	9.724.348 ZAR	16.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(6.690)	(0,00)
1.252.852 US\$	38.557.760 TWD	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.651)	(0,00)
1.244.392 US\$	43.466.942 THB	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(10.609)	(0,00)
5.984.323 US\$	5.701.246 €	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	(100.330)	(0,02)
4.740.902 US\$	32.745.013 CNY	07.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(15.034)	(0,00)
1.243.800 US\$	1.760.947.055 KRW	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(156.592)	(0,03)
425.241 US\$	8.445.751 TRY	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(2.628)	(0,00)
1.927.958 US\$	8.531.214 MYR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(8.753)	(0,00)
393.524 US\$	375.771 €	05.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(7.546)	(0,00)
3.364.510 US\$	4.392.086.007 KRW	06.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(113.741)	(0,03)
966.078 US\$	5.218.272 BRL	01.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(12.093)	(0,00)
452.353 US\$	394.423.394 CLP	09.02.2023	UBS AG	1	(8.777)	(0,00)
14.538.007 US\$	13.898.482 €	05.01.2023	UBS AG	2	(296.202)	(0,06)
6.122.495 US\$	107.960.663 ZAR	16.03.2023	UBS AG	1	(183.942)	(0,04)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
1.257.527 US\$	1.179.546 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	19	(7.437)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
10.792.513 £	13.191.233 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	13	(185.840)	(0,04)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
17.127.816 SEK	1.658.512 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	2	(8.020)	(0,00)
351.296 SEK	33.942 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	(90)	(0,00)
4.714 US\$	49.050 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(13)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
35 US\$	47 SGD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	0	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(2.058.976)</b>	<b>(0,44)</b>

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2021: (0,01 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
56	Euro-BOBL Future March 2023	(69.926)	(0,01)
53	South Korea 3-Year Bond Future March 2023	(36.465)	(0,01)
93	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(53.314)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(159.705)</b>	<b>(0,03)</b>

### Zinsswap-Kontrakte (2,46 %) (31. Dezember 2021: (1,44 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
BRL	14.122.450	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,61 %	1D BROIS	(2.650)	(0,00)
CLP	2.698.258.379	13.04.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,51 %	1D CLICP	(9.626)	(0,00)
PLN	10.353.498	18.11.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,33 %	6M WIBOR	(10.860)	(0,00)
MXN	8.944.028	21.05.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,36 %	28D MXIBTIIE	(31.070)	(0,01)
MXN	63.984.030	27.05.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,58 %	28D MXIBTIIE	(32.980)	(0,01)
MXN	9.645.130	08.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,21 %	28D MXIBTIIE	(38.003)	(0,01)
BRL	16.821.418	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,23 %	1D BROIS	(41.707)	(0,01)
BRL	3.657.400	02.01.2029	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,40 %	1D BROIS	(47.386)	(0,01)
PLN	5.762.547	28.09.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,74 %	6M WIBOR	(55.218)	(0,01)
MXN	74.500.285	22.09.2032	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,00 %	28D MXIBTIIE	(66.261)	(0,01)
CZK	49.562.879	06.12.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,51 %	6M PRIBOR	(67.214)	(0,02)
BRL	4.858.219	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,50 %	1D BROIS	(71.426)	(0,02)
MXN	32.793.698	20.04.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,51 %	28D MXIBTIIE	(81.139)	(0,02)
PLN	9.241.392	30.09.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,86 %	6M WIBOR	(106.674)	(0,02)
BRL	21.400.254	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,66 %	1D BROIS	(107.909)	(0,02)
CLP	1.736.951.022	03.10.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,30 %	1D CLICP	(121.882)	(0,03)
PLN	6.663.067	28.10.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	7,32 %	6M WIBOR	(125.211)	(0,03)
HUF	853.269.217	16.08.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,48 %	6M BUBOR	(137.727)	(0,03)
MXN	37.080.494	05.03.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,17 %	28D MXIBTIIE	(153.511)	(0,03)
MXN	245.500.000	29.05.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,84 %	28D MXIBTIIE	(184.403)	(0,04)
BRL	18.599.109	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,32 %	1D BROIS	(187.484)	(0,04)
MXN	37.351.999	25.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,85 %	28D MXIBTIIE	(195.407)	(0,04)
MXN	61.129.403	01.04.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,45 %	28D MXIBTIIE	(202.547)	(0,04)
MXN	47.500.000	18.06.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,13 %	28D MXIBTIIE	(207.840)	(0,04)
BRL	34.632.671	02.01.2026	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,57 %	1D BROIS	(210.057)	(0,05)
CLP	1.254.313.506	23.01.2030	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,06 %	1D CLICP	(213.707)	(0,05)
HUF	1.138.836.129	04.04.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,51 %	6M BUBOR	(233.503)	(0,05)
CLP	7.548.060.655	14.09.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,80 %	1D CLICP	(239.227)	(0,05)
MXN	60.000.000	16.09.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,38 %	28D MXIBTIIE	(248.083)	(0,05)
MXN	52.921.022	06.04.2026	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	5,82 %	28D MXIBTIIE	(248.741)	(0,05)
CLP	1.377.149.008	24.08.2030	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,15 %	1D CLICP	(336.575)	(0,07)
HUF	1.827.503.721	31.03.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,61 %	6M BUBOR	(365.646)	(0,08)
HUF	470.315.801	11.11.2031	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,69 %	6M BUBOR	(422.896)	(0,09)



## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (2,46 %) (31. Dezember 2021: (1,44 %)) (Fortsetzung)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
HUF	918.555.041	04.10.2031	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,31 %	6M BUBOR	(857.007)	(0,18)
BRL	36.251.861	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,73 %	1D BROIS	(897.123)	(0,19)
CLP	5.863.427.735	17.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	1,36 %	1D CLICP	(905.247)	(0,19)
CLP	5.919.362.976	23.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	1,16 %	1D CLICP	(948.764)	(0,20)
BRL	29.000.000	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,76 %	1D BROIS	(1.191.175)	(0,25)
BRL	68.736.587	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,84 %	1D BROIS	(1.957.519)	(0,42)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>							<b>(11.561.405)</b>	<b>(2,46)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(13.780.086)</b>	<b>(2,93)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>449.322.246</b>	<b>95,56</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>20.859.234</b>	<b>4,44</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>470.181.480</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	338.021.999	66,93
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	98.499.116	19,50
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	1.493.731	0,30
μ Investmentfonds	13.380.558	2,65
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.016.095	0,20
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(3.089.253)	(0,61)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>449.322.246</b>	<b>88,97</b>

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 13,84 % (31. Dezember 2021: 20,52 %)</b>					
<b>Euro</b>					
100.000	Banque Ouest Africaine de Developpement	2,75 %	22.01.2033	81.235	0,15
<b>Euro insgesamt</b>				<b>81.235</b>	<b>0,15</b>
<b>US-Dollar</b>					
200.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	4,60 %	02.11.2047	184.382	0,34
200.000	African Export-Import Bank	2,63 %	17.05.2026	179.904	0,33
200.000	African Export-Import Bank	3,80 %	17.05.2031	165.709	0,31
200.000	African Export-Import Bank	3,99 %	21.09.2029	174.154	0,32
200.000	Banco de Credito e Inversiones SA	3,50 %	12.10.2027	184.440	0,34
200.000	Bank Leumi Le-Israel BM	3,28 %	29.01.2031	177.921	0,33
200.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT	4,75 %	13.05.2025	196.128	0,36
880.000	Banque Ouest Africaine de Developpement	4,70 %	22.10.2031	753.717	1,39
205.000	Banque Ouest Africaine de Developpement	5,00 %	27.07.2027	193.710	0,36
200.000	Cencosud SA	4,38 %	17.07.2027	189.594	0,35
500.000	Corp Nacional del Cobre de Chile	3,15 %	14.01.2030	442.320	0,82
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile	3,70 %	30.01.2050	149.640	0,28
200.000	DP World Ltd	6,85 %	02.07.2037	213.224	0,39
436.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado	3,83 %	14.09.2061	301.238	0,56
200.000	Empresa de Transmision Electrica SA	5,13 %	02.05.2049	161.490	0,30
203.000	First Abu Dhabi Bank PJSC	5,13 %	13.10.2027	207.214	0,38
200.000	LG Chem Ltd	2,38 %	07.07.2031	158.137	0,29
250.000	Malaysia Wakala Sukuk Bhd	3,08 %	28.04.2051	181.428	0,33
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd	2,50 %	03.06.2031	170.905	0,31
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd	3,38 %	28.03.2032	181.549	0,33
200.000	MTR Corp Ltd	1,63 %	19.08.2030	158.665	0,29
292.000	NBK SPC Ltd	1,63 %	15.09.2027	257.340	0,47
200.000	NBK Tier 1 Ltd	3,63 %	29.12.2049	175.077	0,32
200.000	Ooredoo International Finance Ltd	2,63 %	08.04.2031	172.346	0,32
400.000	Shinhan Bank Co Ltd	4,00 %	23.04.2029	356.976	0,66
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd	3,34 %	05.02.2030	183.336	0,34
200.000	Sigma Alimentos SA de CV	4,13 %	02.05.2026	189.845	0,35
200.000	Sigma Finance Netherlands BV	4,88 %	27.03.2028	189.856	0,35
800.000	Tencent Holdings Ltd	3,24 %	03.06.2050	507.250	0,93
220.000	TSMC Arizona Corp	3,25 %	25.10.2051	159.146	0,29
200.000	TSMC Arizona Corp	4,25 %	22.04.2032	193.990	0,36
400.000	UltraTech Cement Ltd	2,80 %	16.02.2031	320.175	0,59
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>7.430.806</b>	<b>13,69</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt *</b>				<b>7.512.041</b>	<b>13,84</b>

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 77,91 % (31. Dezember 2021: 67,43 %)</b>					
<b>Chilenischer Peso</b>					
55.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	2,80 %	01.10.2033	52.973	0,10
40.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,50 %	01.03.2026	45.625	0,08
140.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,70 %	01.09.2030	161.199	0,30
35.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,00 %	01.03.2035	41.439	0,07
20.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	6,00 %	01.01.2043	26.721	0,05
35.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	7,00 %	01.05.2034	47.696	0,09
<b>Chilenischer Peso insgesamt</b>				<b>375.653</b>	<b>0,69</b>
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
100.000	China Government Bond**	1,99 %	09.04.2025	14.265	0,03
200.000	China Government Bond**	2,36 %	02.07.2023	28.798	0,05
900.000	China Government Bond**	2,47 %	02.09.2024	129.793	0,24
600.000	China Government Bond**	2,60 %	01.09.2032	84.472	0,16
800.000	China Government Bond**	2,62 %	25.09.2029	113.831	0,21
560.000	China Government Bond**	2,68 %	21.05.2030	79.791	0,15
1.200.000	China Government Bond**	2,69 %	12.08.2026	173.426	0,32
500.000	China Government Bond**	2,75 %	15.06.2029	71.729	0,13
300.000	China Government Bond**	2,80 %	24.03.2029	43.184	0,08
330.000	China Government Bond**	2,85 %	04.06.2027	47.983	0,09
800.000	China Government Bond**	2,88 %	05.11.2023	115.754	0,21
200.000	China Government Bond**	2,89 %	18.11.2031	28.864	0,05
400.000	China Government Bond**	2,91 %	14.10.2028	58.142	0,11
200.000	China Government Bond**	2,94 %	17.10.2024	29.105	0,05
1.400.000	China Government Bond**	3,02 %	22.10.2025	204.890	0,38
300.000	China Government Bond**	3,02 %	27.05.2031	43.768	0,08
500.000	China Government Bond**	3,03 %	11.03.2026	73.243	0,13
100.000	China Government Bond**	3,12 %	05.12.2026	14.690	0,03
100.000	China Government Bond**	3,12 %	25.10.2052	14.199	0,03
1.000.000	China Government Bond**	3,27 %	19.11.2030	149.080	0,27
2.240.000	China Government Bond**	3,28 %	03.12.2027	331.872	0,61
600.000	China Government Bond**	3,72 %	12.04.2051	93.572	0,17
550.000	China Government Bond**	3,81 %	14.09.2050	87.013	0,16
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>				<b>2.031.464</b>	<b>3,74</b>
<b>Kolumbianischer Peso</b>					
315.063.866	Colombian TES*	2,25 %	18.04.2029	53.454	0,10
219.600.000	Colombian TES*	5,75 %	03.11.2027	34.353	0,06
859.300.000	Colombian TES*	6,00 %	28.04.2028	132.629	0,25
337.600.000	Colombian TES*	7,00 %	26.03.2031	49.315	0,09

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 77,91 % (31. Dezember 2021: 67,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Kolumbianischer Peso (Fortsetzung)</b>					
1.001.800.000	Colombian TES Series G <sup>*</sup>	7,00 %	26.03.2031	146.337	0,27
1.590.700.000	Colombian TES <sup>*</sup>	7,00 %	30.06.2032	223.831	0,41
335.400.000	Colombian TES <sup>*</sup>	7,25 %	18.10.2034	45.721	0,09
711.400.000	Colombian TES <sup>*</sup>	7,75 %	18.09.2030	110.614	0,20
32.300.000	Colombian TES <sup>*</sup>	9,25 %	28.05.2042	4.828	0,01
<b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>				<b>801.082</b>	<b>1,48</b>
<b>Tschechische Krone</b>					
1.550.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	0,05 %	29.11.2029	48.749	0,09
3.240.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	0,25 %	10.02.2027	117.499	0,22
80.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	0,95 %	15.05.2030	2.652	0,01
4.610.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	1,00 %	26.06.2026	176.698	0,33
5.160.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	1,20 %	13.03.2031	169.731	0,31
1.730.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	1,75 %	23.06.2032	57.713	0,11
2.520.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	2,00 %	13.10.2033	83.980	0,15
1.640.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	2,40 %	17.09.2025	67.306	0,12
270.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	2,50 %	25.08.2028	10.382	0,02
2.420.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	2,75 %	23.07.2029	92.721	0,17
720.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	4,20 %	04.12.2036	29.469	0,05
590.000	Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>	5,50 %	12.12.2028	26.484	0,05
<b>Tschechische Krone insgesamt</b>				<b>883.384</b>	<b>1,63</b>
<b>Euro</b>					
400.000	Bulgaria Government International Bond <sup>*</sup>	4,13 %	23.09.2029	420.244	0,78
1.650.000	Chile Government International Bond <sup>*</sup>	0,83 %	02.07.2031	1.379.047	2,54
510.000	Chile Government International Bond <sup>*</sup>	1,88 %	27.05.2030	471.665	0,87
453.000	Hungary Government International Bond <sup>*</sup>	1,63 %	28.04.2032	348.708	0,64
132.000	Hungary Government International Bond <sup>*</sup>	1,75 %	05.06.2035	93.014	0,17
750.000	Indonesia Government International Bond <sup>*</sup>	0,90 %	14.02.2027	705.309	1,30
550.000	Indonesia Government International Bond <sup>*</sup>	1,10 %	12.03.2033	430.753	0,80
1.500.000	Indonesia Government International Bond <sup>*</sup>	1,40 %	30.10.2031	1.254.569	2,31
240.000	Indonesia Government International Bond <sup>*</sup>	3,75 %	14.06.2028	250.037	0,46
400.000	Kazakhstan Government International Bond <sup>*</sup>	0,60 %	30.09.2026	376.193	0,69
700.000	Kazakhstan Government International Bond <sup>*</sup>	1,50 %	30.09.2034	556.548	1,03
940.000	Kazakhstan Government International Bond <sup>*</sup>	2,38 %	09.11.2028	908.178	1,67
691.000	Mexico Government International Bond <sup>*</sup>	2,25 %	12.08.2036	525.519	0,97
250.000	Mexico Government International Bond <sup>*</sup>	2,38 %	11.02.2030	234.318	0,43
838.000	Peruvian Government International Bond <sup>*</sup>	1,25 %	11.03.2033	625.863	1,15
200.000	Peruvian Government International Bond <sup>*</sup>	1,95 %	17.11.2036	147.760	0,27

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 77,91 % (31. Dezember 2021: 67,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
850.000	Philippine Government International Bond*	0,70 %	03.02.2029	753.031	1,39
300.000	Philippine Government International Bond*	1,20 %	28.04.2033	247.730	0,46
700.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	515.703	0,95
187.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	14.04.2033	128.643	0,24
37.000	Romanian Government International Bond*	2,88 %	13.04.2042	22.303	0,04
400.000	Romanian Government International Bond**	3,38 %	08.02.2038	289.535	0,53
73.000	Romanian Government International Bond*	3,38 %	28.01.2050	45.272	0,08
1.160.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	928.782	1,71
633.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	500.448	0,92
193.000	Romanian Government International Bond*	4,63 %	03.04.2049	151.128	0,28
<b>Euro insgesamt</b>				<b>12.310.300</b>	<b>22,68</b>
<b>Ungarischer Forint</b>					
99.900.000	Hungary Government Bond*	4,50 %	23.03.2028	207.182	0,38
<b>Ungarischer Forint insgesamt</b>				<b>207.182</b>	<b>0,38</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>					
4.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,13 %	15.04.2027	247.366	0,45
1.050.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,50 %	15.04.2026	66.220	0,12
300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,25 %	15.06.2036	18.080	0,03
4.700.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.08.2028	299.366	0,55
3.300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	204.189	0,38
300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.07.2037	18.587	0,03
1.900.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50 %	15.06.2025	123.234	0,23
5.906.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50 %	15.02.2031	368.998	0,68
186.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.05.2033	11.634	0,02
300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.05.2027	19.770	0,04
1.800.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	115.877	0,21
900.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2042	58.018	0,11
1.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2043	64.376	0,12
5.250.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.06.2035	347.955	0,64
1.791.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.04.2040	118.470	0,22
84.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,13 %	15.05.2024	5.569	0,01
222.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2036	15.569	0,03
2.200.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2024	146.015	0,27
100.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2034	7.042	0,01
131.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.04.2039	9.329	0,02
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>				<b>2.265.664</b>	<b>4,17</b>

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 77,91 % (31. Dezember 2021: 67,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Malaysischer Ringgit</b>					
645.000	Malaysia Government Bond**	2,63 %	15.04.2031	132.081	0,24
620.000	Malaysia Government Bond**	3,48 %	14.06.2024	140.234	0,26
500.000	Malaysia Government Bond**	3,48 %	15.03.2023	113.450	0,21
710.000	Malaysia Government Bond**	3,50 %	31.05.2027	158.805	0,29
520.000	Malaysia Government Bond**	3,58 %	15.07.2032	113.333	0,21
690.000	Malaysia Government Bond**	3,73 %	15.06.2028	154.793	0,29
40.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	20.04.2023	9.082	0,02
923.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	22.05.2040	193.737	0,36
265.000	Malaysia Government Bond**	3,83 %	05.07.2034	58.294	0,11
70.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	30.11.2026	15.931	0,03
1.400.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	16.11.2027	318.304	0,59
70.000	Malaysia Government Bond**	3,91 %	15.07.2026	15.949	0,03
900.000	Malaysia Government Bond**	3,96 %	15.09.2025	205.337	0,38
140.000	Malaysia Government Bond**	4,07 %	15.06.2050	28.989	0,05
550.000	Malaysia Government Bond**	4,25 %	31.05.2035	125.423	0,23
500.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	30.04.2029	116.532	0,21
510.000	Malaysia Government Bond**	4,70 %	15.10.2042	120.500	0,22
350.000	Malaysia Government Bond**	4,76 %	07.04.2037	83.550	0,15
6.000	Malaysia Government Bond**	4,89 %	08.06.2038	1.450	0,00
<b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>				<b>2.105.774</b>	<b>3,88</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
1.283.600	Mexican Bonos*	5,00 %	06.03.2025	59.768	0,11
7.346.000	Mexican Bonos*	7,50 %	03.06.2027	355.681	0,66
21.825.900	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	1.037.285	1,91
1.150.000	Mexican Bonos*	7,75 %	13.11.2042	51.551	0,09
903.800	Mexican Bonos*	8,00 %	07.11.2047	41.395	0,08
19.965.300	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	997.187	1,84
2.910.000	Mexican Bonos*	8,50 %	18.11.2038	141.433	0,26
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>2.684.300</b>	<b>4,95</b>
<b>Peruanischer Sol</b>					
71.000	Peru Government Bond*	5,35 %	12.08.2040	13.850	0,03
86.000	Peru Government Bond*	5,40 %	12.08.2034	18.059	0,04
135.000	Peru Government Bond*	5,94 %	12.02.2029	32.462	0,06
118.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	27.199	0,05
44.000	Peruvian Government International Bond**	5,20 %	12.09.2023	11.429	0,02
56.000	Peruvian Government International Bond*	5,40 %	12.08.2034	11.760	0,02

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 77,91 % (31. Dezember 2021: 67,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Peruanischer Sol (Fortsetzung)</b>					
724.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	169.999	0,31
<b>Peruanischer Sol insgesamt</b>				<b>284.758</b>	<b>0,53</b>
<b>Polnischer Zloty</b>					
415.000	Republic of Poland Government Bond*	0,25 %	25.10.2026	74.048	0,14
825.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25 %	25.10.2030	126.570	0,23
2.707.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2026	532.990	0,98
609.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2027	115.769	0,21
264.000	Republic of Poland Government Bond**	2,75 %	25.04.2028	49.474	0,09
1.935.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75 %	25.10.2029	346.734	0,64
302.000	Republic of Poland Government Bond**	3,25 %	25.07.2025	63.205	0,12
<b>Polnischer Zloty insgesamt</b>				<b>1.308.790</b>	<b>2,41</b>
<b>Rumänischer neuer Leu</b>					
1.545.000	Romania Government Bond*	2,50 %	25.10.2027	266.118	0,49
255.000	Romania Government Bond*	3,25 %	24.06.2026	48.124	0,09
315.000	Romania Government Bond*	3,65 %	24.09.2031	50.763	0,09
290.000	Romania Government Bond*	4,15 %	24.10.2030	49.352	0,09
155.000	Romania Government Bond*	4,75 %	11.10.2034	24.399	0,04
620.000	Romania Government Bond*	4,85 %	25.07.2029	112.647	0,21
350.000	Romania Government Bond*	5,00 %	12.02.2029	65.282	0,12
335.000	Romania Government Bond*	6,70 %	25.02.2032	66.159	0,12
165.000	Romania Government Bond*	8,25 %	29.09.2032	35.901	0,07
<b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>				<b>718.745</b>	<b>1,32</b>
<b>Thailändischer Baht</b>					
6.000.000	Thailand Government Bond**	0,75 %	17.09.2024	171.090	0,32
1.500.000	Thailand Government Bond**	0,95 %	17.06.2025	42.559	0,08
3.600.000	Thailand Government Bond**	1,00 %	17.06.2027	99.898	0,18
1.330.000	Thailand Government Bond**	1,45 %	17.12.2024	38.267	0,07
7.288.000	Thailand Government Bond*	1,59 %	17.12.2035	178.968	0,33
7.674.000	Thailand Government Bond**	1,60 %	17.12.2029	212.055	0,39
7.380.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.12.2031	204.949	0,38
5.500.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.06.2042	128.238	0,24
1.300.000	Thailand Government Bond**	2,40 %	17.12.2023	37.981	0,07
10.900.000	Thailand Government Bond**	2,65 %	17.06.2028	325.027	0,60
250.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.12.2028	7.534	0,01
62.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.06.2046	1.588	0,00
4.332.000	Thailand Government Bond**	3,30 %	17.06.2038	126.258	0,23

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 77,91 % (31. Dezember 2021: 67,43 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Thailändischer Baht (Fortsetzung)</b>					
200.000	Thailand Government Bond**	3,78 %	25.06.2032	6.340	0,01
<b>Thailändischer Baht insgesamt</b>				<b>1.580.752</b>	<b>2,91</b>
<b>US-Dollar</b>					
200.000	Abu Dhabi Government International Bond*	3,00 %	15.09.2051	143.913	0,26
200.000	Airport Authority*	2,10 %	29.12.2049	182.416	0,34
800.000	Bermuda Government International Bond*	3,72 %	25.01.2027	773.000	1,42
400.000	Bermuda Government International Bond*	5,00 %	15.07.2032	398.066	0,73
231.000	Chile Government International Bond*	2,55 %	27.07.2033	181.478	0,33
200.000	Chile Government International Bond*	3,25 %	21.09.2071	123.873	0,23
200.000	Chile Government International Bond*	4,34 %	07.03.2042	169.728	0,31
200.000	Export Import Bank of Thailand*	5,58 %	20.11.2023	200.695	0,37
200.000	Export-Import Bank of Korea*	4,50 %	15.09.2032	195.705	0,36
200.000	Indonesia Government International Bond*	5,25 %	17.01.2042	197.127	0,36
300.000	Indonesia Government International Bond*	6,63 %	17.02.2037	345.078	0,64
1.490.000	Indonesia Government International Bond*	8,50 %	12.10.2035	1.893.739	3,49
359.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*	1,75 %	15.04.2026	318.279	0,59
200.000	Mexico Government International Bond*	4,88 %	19.05.2033	183.988	0,34
1.526.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	1.289.629	2,38
400.000	Panama Government International Bond*	6,40 %	14.02.2035	406.964	0,75
2.250.000	Panama Government International Bond*	6,70 %	26.01.2036	2.352.836	4,34
430.000	Panama Government International Bond*	9,38 %	01.04.2029	511.551	0,94
1.830.000	Peruvian Government International Bond*	8,75 %	21.11.2033	2.232.710	4,11
200.000	Philippine Government International Bond*	6,38 %	23.10.2034	222.063	0,41
200.000	Philippine Government International Bond*	9,50 %	02.02.2030	255.760	0,47
245.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,75 %	16.11.2032	261.724	0,48
480.000	UAE International Government Bond*	4,95 %	07.07.2052	480.464	0,89
700.000	Uruguay Government International Bond*	4,38 %	23.01.2031	697.046	1,28
280.000	Uruguay Government International Bond*	5,10 %	18.06.2050	275.436	0,51
37.975	Uruguay Government International Bond*	5,75 %	28.10.2034	41.137	0,08
300.000	Uruguay Government International Bond*	7,88 %	15.01.2033	374.877	0,69
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>14.709.282</b>	<b>27,10</b>
<b>Uruguayischer Peso</b>					
858.204	Uruguay Government International Bond*	8,25 %	21.05.2031	18.744	0,04
<b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>				<b>18.744</b>	<b>0,04</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>42.285.874</b>	<b>77,91</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>49.797.915</b>	<b>91,75</b>



## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,83 % (31. Dezember 2021: 1,28 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
82.147.806 CLP	93.807 US\$	09.02.2023	HSBC Bank Plc	2	2.234	0,01
144.287.313 CLP	162.561 US\$	09.02.2023	Morgan Stanley	2	6.129	0,01
1.414.884 CNY	203.950 US\$	17.01.2023	BNP Paribas	2	775	0,00
2.059.878 CNY	296.084 US\$	09.01.2023	BNP Paribas	1	1.770	0,00
1.241.907 CNY	178.577 US\$	09.01.2023	Citibank NA	1	1.000	0,00
4.461 CNY	642 US\$	17.01.2023	Goldman Sachs International	1	3	0,00
494.890 CNY	71.212 US\$	09.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	348	0,00
529.684 CZK	21.603 €	16.03.2023	BNP Paribas	1	144	0,00
3.634.753 CZK	147.822 €	16.03.2023	Citibank NA	1	1.440	0,00
2.944.101 CZK	120.405 €	30.01.2023	HSBC Bank Plc	1	1.127	0,00
1.237.636 CZK	50.542 €	16.03.2023	HSBC Bank Plc	2	266	0,00
3.014.766 CZK	122.933 €	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.540	0,00
28.959 €	143.914 RON	09.02.2023	Citibank NA	1	7	0,00
68.384 €	338.985 RON	09.02.2023	Deutsche Bank AG	2	201	0,00
76.690 €	380.118 RON	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	234	0,00
31.093 €	154.543 RON	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	2	0,00
544.081 €	567.230 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	13.441	0,03
25.718.370 HUF	62.092 €	10.01.2023	Barclays Bank Plc	1	2.107	0,01
8.114.724 HUF	19.548 €	16.03.2023	BNP Paribas	1	225	0,00
47.326.156 HUF	113.004 €	23.01.2023	BNP Paribas	1	4.597	0,01
123.805.821 HUF	296.575 €	23.01.2023	Citibank NA	1	11.007	0,02
97.506.538 HUF	225.647 €	16.03.2023	Citibank NA	2	12.623	0,02
86.125.725 HUF	202.734 €	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	7.477	0,02
7.549.524 HUF	18.110 €	23.01.2023	Goldman Sachs International	1	645	0,00
1.423.314.971 IDR	91.333 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	669	0,00
3.598.130.379 IDR	230.694 US\$	24.01.2023	Citibank NA	1	2.201	0,01
1.023.399.065 IDR	65.444 US\$	15.03.2023	HSBC Bank Plc	1	707	0,00
1.129.665.139 IDR	72.401 US\$	05.01.2023	HSBC Bank Plc	1	254	0,00
2.137.734.373 IDR	137.319 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	862	0,00
4.922.715.873 IDR	315.175 US\$	05.01.2023	Standard Chartered Bank	1	1.433	0,00
106.976.571 KRW	81.599 US\$	19.01.2023	Deutsche Bank AG	1	3.434	0,01
72.431.646 KRW	55.695 US\$	08.02.2023	Goldman Sachs International	1	1.906	0,00
88.128.970 KRW	64.191 US\$	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	5.893	0,01
1.336.231 MXN	66.952 US\$	15.03.2023	HSBC Bank Plc	1	742	0,00
1.428.802 MXN	71.228 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	1.157	0,00
303.016 MYR	68.985 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	563	0,00
689.273 MYR	153.468 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	3.007	0,01
433.528 MYR	98.079 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.114	0,00

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,83 % (31. Dezember 2021: 1,28 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.184.415 PEN	306.256 US\$	16.03.2023	Barclays Bank Plc	1	2.256	0,01
143.934 PEN	37.240 US\$	16.03.2023	BNP Paribas	1	251	0,00
102.067 PEN	26.427 US\$	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	159	0,00
535.107 PHP	9.059 US\$	07.02.2023	Citibank NA	1	550	0,00
510.882 PLN	107.075 €	20.01.2023	HSBC Bank Plc	2	1.912	0,00
591.956 PLN	124.071 €	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	2.212	0,01
275.540 PLN	58.035 €	16.03.2023	Morgan Stanley	2	194	0,00
769.667 PLN	162.151 €	20.01.2023	Morgan Stanley	1	1.986	0,01
14.075 RON	2.828 €	09.02.2023	Barclays Bank Plc	1	4	0,00
568.078 RON	114.174 €	09.02.2023	Goldman Sachs International	2	119	0,00
25.126 SGD	18.600 US\$	25.01.2023	Goldman Sachs International	1	142	0,00
87.250 SGD	64.434 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	648	0,00
4.915.491 THB	142.710 US\$	21.03.2023	Barclays Bank Plc	1	280	0,00
5.063.003 THB	142.800 US\$	03.01.2023	Deutsche Bank AG	2	3.381	0,01
7.176.861 THB	208.508 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	132	0,00
10.991.700 THB	316.204 US\$	03.01.2023	Standard Chartered Bank	1	1.154	0,00
1.940.550 TWD	63.054 US\$	03.01.2023	Citibank NA	1	83	0,00
130.780 US\$	633.009.980 COP	09.02.2023	Goldman Sachs International	2	1.138	0,00
150.600 US\$	661.918 MYR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	335	0,00
63.541 US\$	1.940.550 TWD	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	262	0,00
35.075 US\$	32.845 €	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	20	0,00
20.446 US\$	621.012 TWD	30.01.2023	Morgan Stanley	1	196	0,00
18.623 US\$	568.954 TWD	30.01.2023	Standard Chartered Bank	1	70	0,00
98.690 US\$	476.129.488 COP	09.02.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.178	0,00
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
14.716.976 AUD	9.904.965 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	104.289	0,19
189.098 AUD	128.337 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	272	0,00
<i>Abgesicherte Klassen NOK</i>						
123.761.725 NOK	12.440.336 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	2	161.232	0,30
55.224.808 NOK	5.553.917 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	6	69.140	0,13
4 US\$	38 NOK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b>					<b>446.879</b>	<b>0,83</b>

### Futures-Kontrakte 1,12 % (31. Dezember 2021: 0,55 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(18)	Euro-BOBL Future March 2023	77.034	0,14
(42)	Euro-Bund Future March 2023	371.979	0,69
(6)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	158.551	0,29
9	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	2.391	0,00

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 1,12 % (31. Dezember 2021: 0,55 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
11	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	172	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>610.127</b>	<b>1,12</b>

### Zinsswap-Kontrakte 0,08 % (31. Dezember 2021: 0,06 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens	
COP	678.320.263	31.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,14 %	1D COOVIBR	14.325	0,03
COP	711.742.190	13.04.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	8,37 %	1D COOVIBR	5.704	0,01
COP	193.997.409	06.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,40 %	1D COOVIBR	5.022	0,01
CZK	16.841.776	30.11.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	5,02 %	3M PRIBOR	3.881	0,01
PLN	842.571	14.12.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	5,70 %	6M WIBOR	3.844	0,01
COP	125.606.377	07.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,45 %	1D COOVIBR	3.207	0,01
MXN	614.956	10.11.2031	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,38 %	28D MXIBTIE	2.598	0,00
MXN	494.101	10.11.2031	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,35 %	28D MXIBTIE	2.134	0,00
CLP	6.474.990	05.06.2030	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	2,33 %	1D CLICP	1.470	0,00
COP	129.448.750	11.08.2032	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,02 %	1D COOVIBR	1.200	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten **</b>						<b>43.385</b>	<b>0,08</b>	

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.  
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>50.898.306</b>	<b>93,78</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,63 %) (31. Dezember 2021: (0,20 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
208.335.696 COP	43.157 US\$	09.02.2023	Deutsche Bank AG	2	(489)	(0,00)
602.345.857 COP	124.257 US\$	09.02.2023	Goldman Sachs International	2	(895)	(0,00)
117.333 €	559.658 PLN	20.01.2023	Citibank NA	2	(2.057)	(0,01)
79.429 €	1.947.972 CZK	30.01.2023	Goldman Sachs International	2	(999)	(0,00)
76.883 €	366.447 PLN	20.01.2023	Goldman Sachs International	1	(1.286)	(0,00)
178.101 €	190.191 US\$	04.01.2023	Goldman Sachs International	1	(112)	(0,00)
104.868 €	500.383 PLN	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(915)	(0,00)
91.608 €	38.188.167 HUF	23.01.2023	Goldman Sachs International	1	(3.258)	(0,01)
122.053 €	577.047 PLN	20.01.2023	HSBC Bank Plc	2	(972)	(0,00)
82.158 €	2.009.550 CZK	30.01.2023	HSBC Bank Plc	1	(798)	(0,00)
53.313 €	255.197 PLN	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.140)	(0,00)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,63 %) (31. Dezember 2021: (0,20 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
145.039 €	60.038.294 HUF	10.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(4.824)	(0,01)
15.977 €	390.145 CZK	16.03.2023	Morgan Stanley	1	(37)	(0,00)
75.798 €	31.748.374 HUF	23.01.2023	Morgan Stanley	1	(3.094)	(0,01)
59.989 €	64.371 US\$	16.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(33)	(0,00)
1.014.362.814 IDR	65.663 US\$	05.01.2023	Goldman Sachs International	1	(423)	(0,00)
397.540.883 IDR	25.811 US\$	05.01.2023	Morgan Stanley	1	(242)	(0,00)
59.545 ILS	17.656 US\$	16.03.2023	BNP Paribas	1	(713)	(0,00)
756.149 ILS	221.582 US\$	16.03.2023	Citibank NA	1	(6.432)	(0,01)
284.509 ILS	83.926 US\$	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(2.973)	(0,01)
229.260 MXN	11.616 US\$	15.03.2023	HSBC Bank Plc	1	(2)	(0,00)
406.173 MYR	92.273 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(66)	(0,00)
87.118 RON	17.556 €	09.02.2023	Barclays Bank Plc	1	(32)	(0,00)
236.323 RON	47.639 €	09.02.2023	BNP Paribas	1	(103)	(0,00)
1.108.267 RON	223.559 €	09.02.2023	Goldman Sachs International	3	(642)	(0,00)
4.046.994 THB	118.038 US\$	17.01.2023	BNP Paribas	1	(1.034)	(0,00)
19.321.152 THB	560.547 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(1.951)	(0,00)
832.733 THB	24.255 US\$	21.03.2023	Standard Chartered Bank	1	(31)	(0,00)
1.413.634 THB	41.050 US\$	03.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(234)	(0,00)
1.940.550 TWD	63.262 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(124)	(0,00)
141.326 US\$	4.915.491 THB	03.01.2023	Barclays Bank Plc	1	(597)	(0,00)
76.288 US\$	1.514.427 MXN	15.03.2023	Barclays Bank Plc	1	(434)	(0,00)
177.639 US\$	2.773.167.523 IDR	15.03.2023	BNP Paribas	2	(1.616)	(0,00)
238.008 US\$	8.246.726 THB	03.01.2023	BNP Paribas	1	(96)	(0,00)
2.739.503 US\$	2.587.152 €	05.01.2023	Citibank NA	3	(21.831)	(0,04)
202.361 US\$	191.917 €	04.01.2023	Citibank NA	3	(2.462)	(0,01)
63.065 US\$	1.940.550 TWD	03.01.2023	Citibank NA	1	(72)	(0,00)
60.072 US\$	1.934.618 TWD	30.01.2023	Citibank NA	1	(3.014)	(0,01)
57.223 US\$	1.144.958 MXN	15.03.2023	Citibank NA	1	(782)	(0,00)
249.949 US\$	3.898.130.379 IDR	05.01.2023	Citibank NA	1	(762)	(0,00)
67.582 US\$	67.277 €	20.01.2023	Citibank NA	1	(4.302)	(0,01)
75.619 US\$	66.017.830 CLP	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	(1.564)	(0,00)
62.101 US\$	88.211.667 KRW	08.02.2023	HSBC Bank Plc	1	(8.049)	(0,02)
32.940 US\$	229.798 CNY	09.01.2023	HSBC Bank Plc	1	(288)	(0,00)
63.054 US\$	1.940.550 TWD	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(83)	(0,00)
179.363 US\$	170.000 €	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(2.082)	(0,01)
122.623 US\$	4.306.120 THB	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(1.705)	(0,00)
429.546 US\$	2.966.838 CNY	07.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.362)	(0,00)
97.972 US\$	433.528 MYR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(445)	(0,00)
249.389 US\$	238.129 €	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(4.755)	(0,01)
61.814 US\$	87.514.494 KRW	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(7.782)	(0,02)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,63 %) (31. Dezember 2021: (0,20 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
132.143 US\$	645.253.665 COP	09.02.2023	Morgan Stanley	1	(7)	(0,00)
64.924 US\$	1.302.776 MXN	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(1.076)	(0,00)
171.662 US\$	1.194.390 CNY	09.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(1.044)	(0,00)
228.746 US\$	3.566.154.330 IDR	05.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(614)	(0,00)
17.182 US\$	16.138 €	04.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(41)	(0,00)
85.215 US\$	592.061 CNY	17.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(452)	(0,00)
10.796.990 US\$	10.304.835 €	05.01.2023	Standard Chartered Bank	4	(201.627)	(0,37)
24.033 US\$	482.734 MXN	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(423)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
122.735 US\$	180.496 AUD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(23)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen NOK</i>						
27.880.046 NOK	2.867.895 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	(29.115)	(0,05)
323.884 US\$	3.222.234 NOK	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(4.208)	(0,01)
423.660 US\$	4.181.182 NOK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	(2.073)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(340.697)</b>	<b>(0,63)</b>

### Futures-Kontrakte (0,12 %) (31. Dezember 2021: (0,03 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
7	Euro-BOBL Future March 2023	(8.741)	(0,02)
2	Euro-Schatz Future March 2023	(2.823)	(0,00)
3	South Korea 3-Year Bond Future March 2023	(2.064)	(0,00)
4	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(5.627)	(0,01)
14	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	(8.906)	(0,02)
26	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	(37.828)	(0,07)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(65.989)</b>	<b>(0,12)</b>

### Zinsswap-Kontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2021: (0,36 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens	
CLP	94.826.734	13.04.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,51 %	1D CLICP	(338)	(0,00)
PLN	403.791	18.11.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,33 %	6M WIBOR	(423)	(0,00)
MXN	1.218.795	10.03.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,58 %	28D MXIBTIIE	(658)	(0,00)
MXN	1.500.000	29.05.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,84 %	28D MXIBTIIE	(1.127)	(0,00)
PLN	200.368	28.09.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,74 %	6M WIBOR	(1.920)	(0,00)
CLP	17.013.289	09.11.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	1,24 %	1D CLICP	(2.913)	(0,01)
MXN	3.696.169	22.09.2032	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,00 %	28D MXIBTIIE	(3.287)	(0,01)
HUF	36.352.321	04.08.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,98 %	6M BUBOR	(4.379)	(0,01)
CZK	3.639.165	06.12.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,51 %	6M PRIBOR	(4.935)	(0,01)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2021: (0,36 %)) (Fortsetzung)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens
PLN	277.557	28.10.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	7,32 %	6M WIBOR	(5.216)	(0,01)
PLN	454.061	30.09.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,86 %	6M WIBOR	(5.241)	(0,01)
CLP	39.183.166	17.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	1,36 %	1D CLICP	(6.049)	(0,01)
HUF	38.638.482	16.08.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,48 %	6M BUBOR	(6.237)	(0,01)
HUF	48.178.173	05.08.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,87 %	6M BUBOR	(6.279)	(0,01)
CLP	39.366.311	23.06.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	1,16 %	1D CLICP	(6.310)	(0,01)
CLP	110.169.577	03.10.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,30 %	1D CLICP	(7.731)	(0,02)
CLP	280.576.898	14.09.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,80 %	1D CLICP	(8.892)	(0,02)
HUF	48.273.747	31.03.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,61 %	6M BUBOR	(9.659)	(0,02)
CLP	84.951.903	16.03.2026	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,26 %	1D CLICP	(12.510)	(0,02)
HUF	87.452.452	04.04.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,51 %	6M BUBOR	(17.931)	(0,03)
HUF	26.342.942	11.11.2031	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,69 %	6M BUBOR	(23.687)	(0,04)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>							<b>(135.722)</b>	<b>(0,25)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(542.408)</b>	<b>(1,00)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>50.355.898</b>	<b>92,78</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>3.918.483</b>	<b>7,22</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>54.274.381</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	43.548.681	78,49
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	6.249.234	11,21
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	544.138	0,91
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	13.845	0,03
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>50.355.898</b>	<b>90,75</b>

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 98,40 % (31. Dezember 2021: 97,24 %)</b>			
<b>Brasilianischer Real</b>			
846.078	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*	2.114.030	1,10
453.394	Itau Unibanco Holding SA - Preferred Shares*	2.147.344	1,12
420.299	Klabin SA*	1.587.757	0,83
373.856	Petroleo Brasileiro SA - Preferred Shares*	1.734.572	0,90
<b>Brasilianischer Real insgesamt</b>		<b>7.583.703</b>	<b>3,95</b>
<b>Kanadischer Dollar</b>			
113.670	Parex Resources Inc**	1.690.432	0,88
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>		<b>1.690.432</b>	<b>0,88</b>
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
330.000	Bank of Ningbo Co Ltd Class A*	1.547.728	0,81
101.500	GigaDevice Semiconductor Inc Class A*	1.503.242	0,78
1.598.890	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A*	1.744.744	0,91
10.586	Kweichow Moutai Co Ltd Class A*	2.642.350	1,38
271.600	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A*	1.658.920	0,87
141.882	Montage Technology Co Ltd Class A*	1.283.712	0,67
913.334	Shenzhen Topband Co Ltd Class A*	1.368.909	0,71
554.564	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd Class A*	2.132.861	1,11
192.091	Wingtech Technology Co Ltd Class A*	1.459.801	0,76
130.000	Wuxi NCE Power Co Ltd Class A*	1.457.670	0,76
425.845	Xianhe Co Ltd Class A*	1.875.384	0,98
191.747	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A*	1.769.243	0,92
154.276	Zhejiang HangKe Technology Inc Co Class A*	975.980	0,51
403.147	Zhejiang Juhua Co Ltd Class A*	903.735	0,47
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>22.324.279</b>	<b>11,64</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
597.224	Alibaba Group Holding Ltd*	6.599.731	3,44
508.000	China Mengniu Dairy Co Ltd*	2.304.076	1,20
246.000	Galaxy Entertainment Group Ltd*	1.626.352	0,85
1.154.000	Geely Automobile Holdings Ltd*	1.685.546	0,88
44.700	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd*	1.931.190	1,01
180.695	JD.com Inc Class A*	5.097.924	2,66
98.000	Meituan Class B*	2.193.557	1,14
389.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*	2.574.244	1,34
264.400	Tencent Holdings Ltd*	11.314.563	5,90
175.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares*	1.728.711	0,90
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>37.055.894</b>	<b>19,32</b>

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 98,40 % (31. Dezember 2021: 97,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Ungarischer Forint</b>			
97.289	Richter Gedeon Nyrt*	2.147.576	1,12
<b>Ungarischer Forint insgesamt</b>		<b>2.147.576</b>	<b>1,12</b>
<b>Indische Rupie</b>			
41.219	Apollo Hospitals Enterprise Ltd*	2.230.101	1,16
446.159	Aptus Value Housing Finance India Ltd*	1.630.829	0,85
51.832	Best Agrolife Ltd*	951.089	0,50
59.308	Cartrade Tech Ltd*	334.678	0,17
125.007	DLF Ltd*	565.878	0,29
585.596	EPL Ltd*	1.205.805	0,63
58.049	GMM Pfaudler Ltd*	1.096.006	0,57
170.600	HDFC Bank Ltd*	3.361.272	1,75
21.545	Housing Development Finance Corp Ltd*	688.044	0,36
514.049	ICICI Bank Ltd*	5.543.440	2,89
176.796	IndusInd Bank Ltd*	2.605.353	1,36
50.802	JB Chemicals & Pharmaceuticals Ltd*	1.186.383	0,62
675.886	Motherson Sumi Wiring India Ltd*	475.073	0,25
117.011	Rainbow Children's Medicare Ltd*	1.049.464	0,55
124.550	Reliance Industries Ltd*	3.834.433	2,00
435.562	State Bank of India*	3.235.257	1,69
77.932	Sun Pharmaceutical Industries Ltd*	942.004	0,49
54.269	United Breweries Ltd*	1.111.619	0,58
<b>Indische Rupie insgesamt</b>		<b>32.046.728</b>	<b>16,71</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>			
2.031.200	Bank Central Asia Tbk PT*	1.115.578	0,58
2.992.600	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	1.773.357	0,93
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>		<b>2.888.935</b>	<b>1,51</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>			
812.000	Wal-Mart de Mexico SAB de CV*	2.870.110	1,50
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>		<b>2.870.110</b>	<b>1,50</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
113.200	Accton Technology Corp*	863.672	0,45
601.000	Chunghwa Telecom Co Ltd*	2.209.595	1,15
278.425	Hiwin Technologies Corp*	1.653.221	0,86
102.000	Keystone Microtech Corp*	595.695	0,31
286.021	Tong Hsing Electronic Industries Ltd*	1.777.424	0,93
1.324.000	Uni-President Enterprises Corp*	2.868.943	1,50



## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 98,40 % (31. Dezember 2021: 97,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung)</b>			
120.756	Yageo Corp*	1.771.924	0,92
	<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>	<b>11.740.474</b>	<b>6,12</b>
<b>Polnischer Zloty</b>			
30.491	Dino Polska SA*	2.615.773	1,36
	<b>Polnischer Zloty insgesamt</b>	<b>2.615.773</b>	<b>1,36</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
67.467	Anglo American Plc*	2.628.779	1,37
419.493	Network International Holdings Plc*	1.503.732	0,78
	<b>Britisches Pfund insgesamt</b>	<b>4.132.511</b>	<b>2,15</b>
<b>Katar-Rial</b>			
382.206	Qatar National Bank QPSC*	1.894.532	0,99
	<b>Katar-Rial insgesamt</b>	<b>1.894.532</b>	<b>0,99</b>
<b>Saudi-Arabischer Riyal</b>			
1.194.844	Americana Restaurants International Plc*	969.738	0,50
23.707	Arabian Drilling Co*	710.327	0,37
345.799	Saudi Arabian Oil Co*	2.968.316	1,55
85.361	Saudi National Bank*	1.148.919	0,60
17.710	Saudi Tadawul Group Holding Co*	857.552	0,45
	<b>Saudi-Arabischer Riyal insgesamt</b>	<b>6.654.852</b>	<b>3,47</b>
<b>Südafrikanischer Rand</b>			
185.569	Absa Group Ltd*	2.104.309	1,10
126.943	Bid Corp Ltd*	2.460.896	1,28
8.063	Naspers Ltd Class N*	1.345.493	0,70
	<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>	<b>5.910.698</b>	<b>3,08</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>			
45.747	Hana Financial Group Inc*	1.523.335	0,79
6.371	LG Chem Ltd*	3.042.339	1,59
5.164	NCSOFT Corp*	1.844.704	0,96
20.486	Orion Corp*	2.085.589	1,09
165.170	Samsung Electronics Co Ltd*	7.249.847	3,78
43.835	SK Hynix Inc*	2.615.374	1,36
44.755	SK Telecom Co Ltd*	1.678.932	0,88
5.821	Soulbrain Co Ltd*	1.011.615	0,53
	<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>	<b>21.051.735</b>	<b>10,98</b>

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 98,40 % (31. Dezember 2021: 97,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Thailändischer Baht</b>			
194.800	PTT Exploration & Production PCL*	992.701	0,52
<b>Thailändischer Baht insgesamt</b>		<b>992.701</b>	<b>0,52</b>
<b>VAE-Dirham</b>			
1.976.458	Borouge Plc*	1.361.723	0,71
894.776	Dubai Islamic Bank PJSC*	1.388.774	0,72
<b>Gesamt VAE-Dirham</b>		<b>2.750.497</b>	<b>1,43</b>
<b>US-Dollar</b>			
10.753	Baidu Inc ADR*	1.229.928	0,64
16.744	Credicorp Ltd*	2.271.491	1,18
53.869	Infosys Ltd ADR*	970.181	0,51
98.547	Pagseguro Digital Ltd Class A*	861.301	0,45
14.800	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR*	1.181.632	0,62
179.142	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR*	13.344.287	6,96
73.365	Trip.com Group Ltd ADR*	2.523.756	1,31
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>22.382.576</b>	<b>11,67</b>
<b>Aktien insgesamt</b>		<b>188.734.006</b>	<b>98,40</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>188.734.006</b>	<b>98,40</b>

Devisenterminkontrakte 0,55 % (31. Dezember 2021: 0,12 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
236.767 AUD	154.256 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	7	6.404	0,01
74.123 AUD	48.161 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	2.136	0,00
8.332.686 AUD	5.403.327 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	53	250.885	0,13
11.395 US\$	16.586 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	141	0,00
1.660 US\$	2.408 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	25	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CAD</i>						
439.666 CAD	320.523 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	3.988	0,00
11.402.502 CAD	8.342.521 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	73.504	0,04
45.401 US\$	60.744 CAD	18.01.2023	Royal Bank Of Canada	1	567	0,00
387.677 US\$	519.016 CAD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	4.598	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
76.173 €	79.281 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	2.097	0,00
13.246 €	13.846 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	305	0,00
6.113.249 €	6.091.352 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	28	439.609	0,23
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
214.309 £	241.344 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	16.550	0,01

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,55 % (31. Dezember 2021: 0,12 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>						
325.239 £	370.123 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	21.263	0,01
169.236 US\$	139.110 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	1.833	0,00
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
17.108 US\$	291.145 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	18	0,00
5 US\$	86 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	1	0,00
69.834.229 ZAR	3.887.918 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	12	211.166	0,11
1.168.139 ZAR	65.640 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	2.927	0,00
5.766.041 ZAR	322.653 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	62	15.796	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b>					<b>1.053.813</b>	<b>0,55</b>
					<b>Zeitwert % des Netto-</b>	
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>189.787.819</b>	<b>98,95</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,35 %) (31. Dezember 2021: (0,18 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
59.343 AUD	40.437 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(169)	(0,00)
72.405 AUD	49.377 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(246)	(0,00)
231.417 US\$	356.157 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	11	(10.257)	(0,01)
15.197 US\$	22.673 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(187)	(0,00)
3.943.568 US\$	6.086.056 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	25	(186.176)	(0,10)
<i>Abgesicherte Klassen CAD</i>						
1.120.715 CAD	838.108 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(10.924)	(0,01)
1.116.246 CAD	831.862 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(7.976)	(0,01)
428.022 US\$	586.190 CAD	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(4.637)	(0,00)
292.141 US\$	399.432 CAD	18.01.2023	Royal Bank Of Canada	4	(2.673)	(0,00)
719.482 US\$	984.665 CAD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(7.285)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
24.395 €	26.155 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(93)	(0,00)
123.492 US\$	121.873 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(6.708)	(0,00)
88.471 US\$	86.747 €	18.01.2023	UBS AG	3	(4.203)	(0,00)
4.026.767 US\$	4.044.170 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	23	(293.737)	(0,15)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
148.082 £	181.182 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(2.984)	(0,00)
9.756 US\$	8.797 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(830)	(0,00)
84.189 US\$	73.307 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	12	(4.026)	(0,00)

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,35 %) (31. Dezember 2021: (0,18 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
1.876.398 US\$	33.764.130 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	8	(105.467)	(0,06)
140.633 US\$	2.491.556 ZAR	18.01.2023	UBS AG	5	(5.614)	(0,00)
240.594 US\$	4.314.667 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	31	(12.667)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(666.859)</b>	<b>(0,35)</b>
					<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto-</b>
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(666.859)</b>	<b>(0,35)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>189.120.960</b>	<b>98,60</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>2.686.795</b>	<b>1,40</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>191.807.755</b>	<b>100,00</b>
					<b>US\$</b>	<b>% des</b>
					<b>Gesamtver-</b>	<b>mögens</b>
<b>Portfolioanalyse</b>						
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind					187.043.574	95,40
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden					1.690.432	0,86
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente					386.954	0,20
<b>Anlagen insgesamt</b>					<b>189.120.960</b>	<b>96,46</b>

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 96,44 % (31. Dezember 2021: 98,25 %)</b>			
<b>Brasilianischer Real</b>			
395.375	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*	987.893	1,05
221.010	Itau Unibanco Holding SA - Preferred Shares*	1.046.738	1,12
200.827	Klabin SA*	758.661	0,81
<b>Brasilianischer Real insgesamt</b>		<b>2.793.292</b>	<b>2,98</b>
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
216.400	Bank of Ningbo Co Ltd Class A*	1.014.935	1,08
828.337	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A*	903.899	0,96
6.600	Kweichow Moutai Co Ltd Class A*	1.647.412	1,76
161.000	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A*	983.380	1,05
483.100	Shenzhen Topband Co Ltd Class A*	724.072	0,77
108.100	Wingtech Technology Co Ltd Class A*	821.509	0,88
57.200	Wuxi NCE Power Co Ltd Class A*	641.375	0,68
212.273	Xianhe Co Ltd Class A*	934.831	1,00
138.160	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A*	1.274.798	1,36
80.806	Zhejiang HangKe Technology Inc Co Class A*	511.195	0,55
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>9.457.406</b>	<b>10,09</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
309.320	Alibaba Group Holding Ltd*	3.418.196	3,65
653.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd - H Shares*	798.163	0,85
299.000	China Mengniu Dairy Co Ltd*	1.356.139	1,45
558.000	Geely Automobile Holdings Ltd*	815.021	0,87
27.100	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd*	1.170.811	1,25
105.350	JD.com Inc Class A*	2.972.225	3,17
54.500	Meituan Class B*	1.219.886	1,30
187.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*	1.240.799	1,32
134.600	Tencent Holdings Ltd*	5.759.986	6,14
104.888	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares*	1.036.120	1,10
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>19.787.346</b>	<b>21,10</b>
<b>Indische Rupie</b>			
22.538	Apollo Hospitals Enterprise Ltd*	1.219.389	1,30
91.369	DLF Ltd*	413.607	0,44
2.253	GMM Pfaudler Ltd*	42.538	0,05
29.989	Housing Development Finance Corp Ltd*	957.705	1,02
91.816	IndusInd Bank Ltd*	1.353.046	1,44
324.893	Motherson Sumi Wiring India Ltd*	228.364	0,24
75.313	Reliance Industries Ltd*	2.318.608	2,47

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Aktien 96,44 % (31. Dezember 2021: 98,25 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Indische Rupie (Fortsetzung)</b>			
67.006	State Bank of India*	497.706	0,53
28.182	United Breweries Ltd*	577.266	0,62
<b>Indische Rupie insgesamt</b>		<b>7.608.229</b>	<b>8,11</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>			
2.110.300	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	1.250.523	1,33
6.570.400	Kalbe Farma Tbk PT*	882.103	0,94
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>		<b>2.132.626</b>	<b>2,27</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>			
459.686	Wal-Mart de Mexico SAB de CV*	1.624.815	1,73
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>		<b>1.624.815</b>	<b>1,73</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
41.000	Accton Technology Corp*	312.814	0,33
269.000	Chunghwa Telecom Co Ltd*	988.987	1,06
80.000	Eclat Textile Co Ltd*	1.289.714	1,38
127.800	Hiwin Technologies Corp*	758.846	0,81
513.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*	7.485.822	7,98
131.596	Tong Hsing Electronic Industries Ltd*	817.779	0,87
689.000	Uni-President Enterprises Corp*	1.492.977	1,59
44.796	Yageo Corp*	657.318	0,70
<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>		<b>13.804.257</b>	<b>14,72</b>
<b>Polnischer Zloty</b>			
17.662	Dino Polska SA*	1.515.194	1,62
<b>Polnischer Zloty insgesamt</b>		<b>1.515.194</b>	<b>1,62</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
35.697	Anglo American Plc*	1.390.895	1,48
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>1.390.895</b>	<b>1,48</b>
<b>Katar-Rial</b>			
208.616	Qatar National Bank QPSC*	1.034.075	1,10
<b>Katar-Rial insgesamt</b>		<b>1.034.075</b>	<b>1,10</b>
<b>Saudi-Arabischer Riyal</b>			
581.415	Americana Restaurants International Plc*	471.877	0,50
41.500	Saudi National Bank*	558.571	0,60

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 96,44 % (31. Dezember 2021: 98,25 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Saudi-Arabischer Riyal (Fortsetzung)</b>			
7.734	Saudi Tadawul Group Holding Co*	374.495	0,40
<b>Saudi-Arabischer Riyal insgesamt</b>		<b>1.404.943</b>	<b>1,50</b>
<b>Südafrikanischer Rand</b>			
89.089	Absa Group Ltd*	1.010.249	1,08
69.092	Bid Corp Ltd*	1.339.406	1,43
3.936	Naspers Ltd Class N*	656.810	0,70
<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>		<b>3.006.465</b>	<b>3,21</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>			
27.344	Hana Financial Group Inc*	910.531	0,97
3.038	LG Chem Ltd*	1.450.734	1,55
2.742	NCSOFT Corp*	979.508	1,04
12.494	Orion Corp*	1.271.959	1,36
95.477	Samsung Electronics Co Ltd*	4.190.795	4,47
24.237	SK Hynix Inc*	1.446.077	1,54
26.379	SK Telecom Co Ltd*	989.578	1,06
2.809	Soulbrain Co Ltd*	488.168	0,52
<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>		<b>11.727.350</b>	<b>12,51</b>
<b>Thailändischer Baht</b>			
887.876	Ngern Tid Lor PCL*	756.239	0,81
<b>Thailändischer Baht insgesamt</b>		<b>756.239</b>	<b>0,81</b>
<b>VAE-Dirham</b>			
1.105.203	Borouge Plc*	761.453	0,81
387.176	Dubai Islamic Bank PJSC*	600.933	0,64
<b>Gesamt VAE-Dirham</b>		<b>1.362.386</b>	<b>1,45</b>
<b>US-Dollar</b>			
8.157	Credicorp Ltd*	1.106.579	1,18
7.525	Fabrinet*	964.855	1,03
25.047	HDFC Bank Ltd ADR*	1.713.465	1,83
150.180	ICICI Bank Ltd ADR*	3.287.440	3,51
26.088	Infosys Ltd ADR*	469.845	0,50
57.507	Pagseguro Digital Ltd Class A*	502.611	0,54
6.929	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR*	553.211	0,59
15.093	State Bank of India GDR**	1.119.901	1,19

## Emerging Markets Select Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 96,44 % (31. Dezember 2021: 98,25 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
37.894	Trip.com Group Ltd ADR <sup>†</sup>	1.303.554	1,39
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>11.021.461</b>	<b>11,76</b>
<b>Aktien insgesamt</b>		<b>90.426.979</b>	<b>96,44</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>90.426.979</b>	<b>96,44</b>
		<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>90.426.979</b>	<b>96,44</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>		<b>90.426.979</b>	<b>96,44</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>		<b>3.335.143</b>	<b>3,56</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>93.762.122</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtver- mögens</b>
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	89.307.078	94,93
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.119.901	1,19
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>90.426.979</b>	<b>96,12</b>



## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 4,78 % (31. Dezember 2021: 3,79 %)</b>					
<b>Euro</b>					
213.901	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	4,89 %	24.02.2058	203.238	0,42
199.494	Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A	3,63 %	31.07.2044	199.895	0,41
925.281	Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A	3,15 %	24.01.2026	925.968	1,91
600.000	Primrose Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class D	4,40 %	24.10.2061	559.811	1,15
262.247	Sabadell Consumo 2 FDT Series 2 Class D	6,89 %	24.12.2034	262.198	0,54
177.029	Warrington Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class A1	3,89 %	24.12.2056	168.106	0,35
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>2.319.216</b>	<b>4,78</b>
<b>Unternehmensanleihen 49,33 % (31. Dezember 2021: 31,94 %)</b>					
<b>Dänische Krone</b>					
3.500.000	Nykredit Realkredit AS*	2,00 %	01.10.2053	386.452	0,79
3.000.000	Nykredit Realkredit AS*	2,50 %	01.10.2053	344.134	0,71
2.000.000	Nykredit Realkredit AS*	5,00 %	01.10.2053	265.181	0,55
<b>Dänische Krone insgesamt</b>				<b>995.767</b>	<b>2,05</b>
<b>Euro</b>					
200.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	181.358	0,37
200.000	Altice France SA*	3,38 %	15.01.2028	151.390	0,31
250.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	0,75 %	20.04.2028	200.483	0,41
280.000	American Tower Corp*	0,88 %	21.05.2029	223.699	0,46
100.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	2,00 %	01.09.2028	81.000	0,17
300.000	Arkema SA*	1,50 %	29.12.2049	254.239	0,52
400.000	Aroundtown SA*	0,38 %	15.04.2027	265.322	0,55
200.000	Aroundtown SA*	3,38 %	29.12.2049	97.157	0,20
300.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	256.996	0,53
400.000	Athene Global Funding*	0,83 %	08.01.2027	340.744	0,70
600.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	494.130	1,02
400.000	Autostrade per l'Italia SpA*	2,00 %	04.12.2028	330.343	0,68
200.000	Banco Santander SA*	3,63 %	29.12.2049	139.255	0,29
1.000.000	Bank of Montreal*	0,20 %	26.01.2023	998.945	2,06
400.000	Bank of New Zealand*	2,55 %	29.06.2027	383.520	0,79
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,96 %	29.12.2049	155.148	0,32
200.000	Barclays Bank Plc*	2,76 %	29.12.2049	144.124	0,30
400.000	BNP Paribas SA*	6,88 %	29.12.2049	396.500	0,82
500.000	BPCE SFH SA*	3,13 %	24.01.2028	495.001	1,02
500.000	CaixaBank SA*	1,13 %	12.01.2023	499.758	1,03
200.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	173.333	0,36
400.000	Commonwealth Bank of Australia*	0,75 %	28.02.2028	349.180	0,72
400.000	Commonwealth Bank of Australia*	3,25 %	24.10.2025	397.537	0,82

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 49,33 % (31. Dezember 2021: 31,94 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
400.000	Commonwealth Bank of Australia*	0,75 %	28.02.2028	349.180	0,72
400.000	Commonwealth Bank of Australia*	3,25 %	24.10.2025	397.537	0,82
500.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA*	2,75 %	08.12.2027	486.659	1,00
300.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA*	4,13 %	16.01.2023	300.242	0,62
400.000	Credit Suisse Group AG*	0,65 %	14.01.2028	299.787	0,62
600.000	Digital Intrepid Holding BV*	1,38 %	18.07.2032	429.158	0,88
200.000	Electricite de France SA*	2,88 %	29.12.2049	164.508	0,34
500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,38 %	31.08.2081	371.559	0,77
500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	2,13 %	31.08.2081	337.488	0,70
100.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50 %	30.06.2029	80.357	0,17
419.000	European Union*	1,25 %	04.02.2043	295.240	0,61
440.000	European Union*	1,63 %	04.12.2029	401.248	0,83
352.000	European Union*	2,75 %	04.12.2037	327.695	0,67
211.000	European Union*	3,00 %	04.03.2053	202.699	0,42
300.000	Evonik Industries AG*	1,38 %	02.09.2081	245.535	0,51
300.000	Grand City Properties SA*	2,50 %	29.12.2049	136.184	0,28
400.000	Holcim Finance Luxembourg SA*	3,00 %	29.12.2049	386.072	0,80
500.000	ING Groep NV*	4,88 %	14.11.2027	509.729	1,05
200.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	154.500	0,32
250.000	Intesa Sanpaolo SpA*	3,75 %	29.12.2049	213.457	0,44
100.000	Johnson Controls International Plc/Tyco Fire & Security Finance SCA*	3,00 %	15.09.2028	94.834	0,20
300.000	KBC Bank NV*	2,00 %	31.01.2023	300.019	0,62
224.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.09.2031	172.292	0,35
784.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau**	0,38 %	09.03.2026	724.510	1,49
553.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau**	0,75 %	28.06.2028	490.285	1,01
551.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,75 %	15.01.2029	481.840	0,99
403.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	1,25 %	30.06.2027	373.629	0,77
400.000	Liberty Mutual Group Inc*	4,63 %	02.12.2030	382.491	0,79
200.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	140.324	0,29
500.000	National Australia Bank Ltd*	2,35 %	30.08.2029	466.220	0,96
300.000	NatWest Group Plc*	0,67 %	14.09.2029	238.979	0,49
300.000	Petroleos Mexicanos*	4,75 %	26.02.2029	234.870	0,48
200.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50 %	15.02.2025	175.875	0,36
400.000	PVH Corp**	3,13 %	15.12.2027	366.173	0,75
100.000	RCI Banque SA*	0,50 %	14.07.2025	91.131	0,19
109.000	RCI Banque SA*	1,75 %	12.01.2023	108.986	0,22
200.000	Repsol International Finance BV*	2,50 %	29.12.2049	172.564	0,36
200.000	Ryanair DAC*	0,88 %	25.05.2026	179.257	0,37
400.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	1,00 %	12.08.2027	279.726	0,58

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 49,33 % (31. Dezember 2021: 31,94 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
200.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB <sup>*</sup>	2,63 %	29.12.2049	78.571	0,16
200.000	SoftBank Group Corp <sup>*</sup>	5,00 %	15.04.2028	170.597	0,35
300.000	Solvay SA <sup>*</sup>	2,50 %	29.12.2049	265.569	0,55
470.000	Southern Co <sup>*</sup>	1,88 %	15.09.2081	368.948	0,76
225.000	Sr-boligkreditt AS <sup>*</sup>	0,01 %	08.09.2028	187.073	0,39
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup>	1,63 %	15.10.2028	149.162	0,31
400.000	TotalEnergies SE <sup>*</sup>	2,00 %	29.12.2049	342.780	0,71
400.000	Toyota Motor Credit Corp <sup>*</sup>	2,38 %	01.02.2023	400.143	0,82
200.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE <sup>*</sup>	2,13 %	29.12.2049	171.968	0,35
200.000	UniCredit SpA <sup>**</sup>	3,88 %	29.12.2049	149.347	0,31
200.000	UniCredit SpA <sup>*</sup>	4,45 %	29.12.2049	150.348	0,31
200.000	United Group BV <sup>**</sup>	3,13 %	15.02.2026	161.350	0,33
500.000	Veolia Environnement SA <sup>*</sup>	2,50 %	29.12.2049	399.965	0,82
500.000	Verizon Communications Inc <sup>*</sup>	4,25 %	31.10.2030	506.807	1,04
400.000	Vivion Investments Sarl <sup>*</sup>	3,00 %	08.08.2024	312.821	0,64
300.000	Vodafone Group Plc <sup>*</sup>	3,00 %	27.08.2080	240.186	0,49
400.000	Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup>	3,75 %	29.12.2049	341.150	0,70
400.000	Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup>	4,38 %	29.12.2049	327.744	0,68
250.000	Westpac Banking Corp <sup>*</sup>	0,38 %	02.04.2026	226.636	0,47
200.000	Wizz Air Finance Co BV <sup>*</sup>	1,00 %	19.01.2026	166.035	0,34
<b>Euro insgesamt</b>				<b>22.942.484</b>	<b>47,28</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>23.938.251</b>	<b>49,33</b>
<b>Staatsanleihen 40,49 % (31. Dezember 2021: 54,09 %)</b>					
<b>Euro</b>					
210.000	Acquirente Unico SpA <sup>*</sup>	2,80 %	20.02.2026	201.269	0,41
957.000	Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>	3,00 %	30.05.2029	866.345	1,78
300.000	Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>	4,00 %	08.09.2027	294.017	0,61
467.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe <sup>*</sup>	0,00 %	15.08.2031	379.233	0,78
722.558	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe <sup>*</sup>	1,25 %	15.08.2048	562.734	1,16
171.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe <sup>*</sup>	1,70 %	15.08.2032	159.462	0,33
110.150	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe <sup>*</sup>	2,50 %	15.08.2046	110.968	0,23
863.000	Croatia Government International Bond <sup>*</sup>	1,50 %	17.06.2031	717.674	1,48
450.000	Croatia Government International Bond <sup>*</sup>	2,88 %	22.04.2032	415.113	0,85
595.000	Estonia Government International Bond <sup>*</sup>	4,00 %	12.10.2032	610.888	1,26
381.000	French Republic Government Bond OAT <sup>*</sup>	0,75 %	25.02.2028	343.785	0,71
177.486	French Republic Government Bond OAT <sup>*</sup>	0,75 %	25.05.2052	95.517	0,20
168.000	French Republic Government Bond OAT <sup>*</sup>	1,25 %	25.05.2036	131.824	0,27
1.067.044	French Republic Government Bond OAT <sup>*</sup>	1,25 %	25.05.2038	808.643	1,67
202.438	French Republic Government Bond OAT <sup>*</sup>	1,75 %	25.05.2066	139.144	0,29

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens	
<b>Staatsanleihen 40,49 % (31. Dezember 2021: 54,09 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
902.850	French Republic Government Bond OAT*	2,00 %	25.11.2032	823.945	1,70
35.000	Ireland Government Bond*	0,55 %	22.04.2041	22.047	0,04
1.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT**	0,00 %	28.02.2023	997.378	2,05
178.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,00 %	01.04.2026	158.256	0,33
227.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,00 %	01.08.2026	199.387	0,41
590.912	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,65 %	28.10.2027	557.487	1,15
606.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,20 %	15.08.2025	571.320	1,18
1.385.320	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40 %	26.05.2025	1.369.993	2,82
950.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,75 %	30.05.2024	930.445	1,92
560.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,85 %	01.07.2025	538.452	1,11
416.474	Kingdom of Belgium Government Bond*	0,40 %	22.06.2040	254.608	0,52
266.000	Lithuania Government International Bond*	2,13 %	01.06.2032	232.759	0,48
300.000	Lithuania Government International Bond*	4,13 %	25.04.2028	308.122	0,63
780.390	Netherlands Government Bond*	0,00 %	15.07.2030	635.854	1,31
575.392	Netherlands Government Bond*	0,00 %	15.07.2031	455.670	0,94
1.618.457	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	1,65 %	16.07.2032	1.379.201	2,84
777.300	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	1,95 %	15.06.2029	726.217	1,50
313.000	Republic of Austria Government Bond*	0,90 %	20.02.2032	258.881	0,53
291.000	Romanian Government International Bond*	1,75 %	13.07.2030	203.131	0,42
366.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	245.534	0,51
142.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	105.165	0,22
1.217.000	Slovakia Government Bond*	4,00 %	19.10.2032	1.254.731	2,58
326.337	SNCF Reseau*	2,45 %	28.02.2023	327.970	0,68
526.000	Spain Government Bond*	0,70 %	30.04.2032	410.007	0,84
525.000	Spain Government Bond*	0,85 %	30.07.2037	350.150	0,72
186.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,45 %	16.02.2043	138.754	0,29
441.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,65 %	22.02.2038	358.473	0,74
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>19.650.553</b>	<b>40,49</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>45.908.020</b>	<b>94,60</b>

Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2021: 0,41 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht- realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
3.422 €	2.962 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	86	0,00
293.456 €	255.539 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	5.615	0,01
10.244 €	10.118 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	774	0,00
419.724 €	367.082 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	6.239	0,01
79.267.340 ¥	546.612 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	16.814	0,04
1.008.941 ¥	7.133 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	38	0,00

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2021: 0,41 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
70.214 €	74.454 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	522	0,00
111.947 €	109.307 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	9.631	0,02
14.707.644 US\$	13.766.923 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	26	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>39.745</b>	<b>0,08</b>

### Futures-Kontrakte 3,09 % (31. Dezember 2021: 0,80 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
(7)	Canadian 10-Year Bond Future March 2023	13.796	0,03
(20)	Euro-BOBL Future March 2023	85.800	0,18
(20)	Euro-BTP Future March 2023	105.258	0,22
(52)	Euro-Bund Future March 2023	416.934	0,86
25	Euro-Bund Put Option on Future February 2023, Strike Price EUR 136	68.309	0,14
(19)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	483.160	0,99
(20)	Euro-OAT Future March 2023	180.643	0,37
(70)	Euro-Schatz Future March 2023	98.000	0,20
(18)	Short-Term Euro-BTP Future March 2023	32.130	0,07
(4)	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	13.706	0,03
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>1.497.736</b>	<b>3,09</b>

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,13 % (31. Dezember 2021: 0,14 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens	
EUR	2.000.000	18.10.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	2,68 %	CPTFEMU	27.956	0,06
EUR	1.000.000	19.05.2026	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	3,52 %	CPTFEMU	18.728	0,04
USD	2.000.000	18.10.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,75 %	CPTFEMU	14.840	0,03
EUR	1.250.000	23.09.2025	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	3,58 %	CPTFEMU	465	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten<sup>‡</sup></b>						<b>61.989</b>	<b>0,13</b>	

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2021: 0,20 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens	
EUR	100.000	11.01.2029	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	0,82 %	6M EURIBOR	12.884	0,03
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>12.884</b>	<b>0,03</b>	

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert % des Netto- EUR vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>47.520.374 97,93</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,13 %) (31. Dezember 2021: (0,03 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
548.917 €	79.536.332 ¥	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(16.421)	(0,03)
387.888 £	450.076 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(13.155)	(0,03)
258.500 £	295.665 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(4.488)	(0,01)
10.117 US\$	10.074 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(605)	(0,00)
933 US\$	945 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(71)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
248.827 US\$	243.205 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(10.293)	(0,02)
104.003 US\$	102.526 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(5.176)	(0,01)
14.424.367 US\$	14.483.655 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(981.865)	(2,03)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(1.032.074)</b>	<b>(2,13)</b>

### Futures-Kontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2021: (0,04 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
19	3-Month Euro EURIBOR Future December 2023	(89.063)	(0,18)
38	Canadian 2-Year Bond Future March 2023	(14.453)	(0,03)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>			<b>(103.516) (0,21)</b>

### Inflation-Swap-Kontrakte (0,14 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens	
USD	2.000.000	18.10.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	2,62 %	CPTFEMU	(8.585)	(0,02)
EUR	1.000.000	19.05.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	4,73 %	CPTFEMU	(22.405)	(0,05)
EUR	2.000.000	18.10.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,47 %	CPTFEMU	(36.579)	(0,07)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>(67.569)</b>	<b>(0,14)</b>	

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,09 %) (31. Dezember 2021: (0,02 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens	
EUR	2.600.000	16.09.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,17 %	12M EURIBOR	(43.820)	(0,09)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>(43.820)</b>	<b>(0,09)</b>	

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2021: (0,87 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens	
EUR	3.000.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover S38	(32.637)	(0,07)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b>				<b>(32.637)</b>	<b>(0,07)</b>	

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.279.616)</b>	<b>(2,64)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>46.240.758</b>	<b>95,29</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>2.287.118</b>	<b>4,71</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>48.527.876</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	EUR	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	36.253.838	56,75
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	9.654.182	15,11
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.394.220	2,18
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(1.061.482)	(1,66)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>46.240.758</b>	<b>72,38</b>

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 4,98 % (31. Dezember 2021: 2,66 %)</b>					
<b>Euro</b>					
42.780	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	4,89 %	24.02.2058	40.648	0,44
157.298	Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A	3,04 %	24.01.2026	157.414	1,69
100.000	Primrose Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class D	4,40 %	24.10.2061	93.302	1,00
87.416	Sabadell Consumo 2 FDT Series 2 Class D	6,89 %	24.12.2034	87.399	0,94
88.515	Warrington Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class A1	3,89 %	24.12.2056	84.053	0,91
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>462.816</b>	<b>4,98</b>
<b>Unternehmensanleihen 43,88 % (31. Dezember 2021: 39,49 %)</b>					
<b>Euro</b>					
100.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	90.679	0,98
100.000	Altice France SA*	3,38 %	15.01.2028	75.695	0,81
100.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	0,75 %	20.04.2028	80.193	0,86
100.000	American Tower Corp*	0,88 %	21.05.2029	79.892	0,86
100.000	Aroundtown SA*	0,38 %	15.04.2027	66.330	0,71
100.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	85.666	0,92
100.000	Athene Global Funding*	0,83 %	08.01.2027	85.186	0,92
100.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	82.355	0,89
100.000	Autostrade per l'Italia SpA*	2,00 %	04.12.2028	82.586	0,89
200.000	Banco Santander SA*	3,63 %	29.12.2049	139.255	1,50
100.000	Bank of New Zealand*	2,55 %	29.06.2027	95.880	1,03
90.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,96 %	29.12.2049	69.817	0,75
60.000	Barclays Bank Plc*	2,76 %	29.12.2049	43.237	0,46
100.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	84.175	0,91
100.000	BPCE SFH SA*	3,13 %	24.01.2028	99.000	1,06
100.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	86.666	0,93
100.000	Commonwealth Bank of Australia*	3,25 %	24.10.2025	99.384	1,07
100.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA*	2,75 %	08.12.2027	97.332	1,05
100.000	Credit Suisse Group AG*	0,65 %	14.01.2028	74.947	0,81
100.000	Dexia Credit Local SA*	0,63 %	17.01.2026	92.549	1,00
100.000	Digital Intrepid Holding BV*	1,38 %	18.07.2032	71.526	0,77
100.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,38 %	31.08.2081	74.312	0,80
90.000	European Stability Mechanism*	1,00 %	23.06.2027	82.544	0,89
78.000	European Union*	1,25 %	04.02.2043	54.961	0,59
95.000	European Union*	1,63 %	04.12.2029	86.633	0,93
111.000	European Union*	2,00 %	04.10.2027	106.018	1,14
69.000	European Union*	2,75 %	04.12.2037	64.236	0,69
38.000	European Union*	3,00 %	04.03.2053	36.505	0,39
100.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00 %	31.03.2029	77.233	0,83
100.000	Grand City Properties SA*	2,50 %	29.12.2049	45.395	0,49



## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 43,88 % (31. Dezember 2021: 39,49 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
100.000	ING Groep NV*	4,88 %	14.11.2027	101.946	1,10
100.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50 %	01.09.2026	55.563	0,60
97.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.06.2026	87.789	0,94
55.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.09.2031	42.304	0,45
100.000	Kutxabank SA*	1,25 %	22.09.2025	94.397	1,02
100.000	Liberty Mutual Group Inc*	4,63 %	02.12.2030	95.623	1,03
100.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	70.162	0,75
100.000	National Australia Bank Ltd*	2,35 %	30.08.2029	93.244	1,00
100.000	Nationale-Niederlanden Bank NV*	1,00 %	25.09.2028	88.368	0,95
100.000	NatWest Group Plc*	0,67 %	14.09.2029	79.660	0,86
100.000	Petroleos Mexicanos*	4,75 %	26.02.2029	78.290	0,84
100.000	PVH Corp**	3,13 %	15.12.2027	91.543	0,98
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	1,00 %	12.08.2027	69.932	0,75
130.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	102.049	1,10
100.000	United Group BV**	3,13 %	15.02.2026	80.675	0,87
100.000	Verizon Communications Inc*	4,25 %	31.10.2030	101.361	1,09
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,00 %	08.08.2024	78.205	0,84
100.000	Volkswagen International Finance NV*	3,75 %	29.12.2049	85.287	0,92
100.000	Volkswagen International Finance NV*	4,38 %	29.12.2049	81.936	0,88
100.000	Westpac Banking Corp*	0,38 %	02.04.2026	90.655	0,98
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>4.079.176</b>	<b>43,88</b>
<b>Staatsanleihen 43,09 % (31. Dezember 2021: 51,01 %)</b>					
<b>Euro</b>					
100.000	Acquirente Unico SpA*	2,80 %	20.02.2026	95.843	1,03
75.000	Autonomous Community of Madrid Spain*	2,08 %	12.03.2030	68.305	0,74
100.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	3,00 %	30.05.2029	90.527	0,97
100.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	4,00 %	08.09.2027	98.006	1,05
55.600	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2030	46.318	0,50
80.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,50 %	15.02.2028	72.514	0,78
92.163	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	1,25 %	15.08.2048	71.777	0,77
109.036	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	1,70 %	15.08.2032	101.679	1,09
52.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	4,75 %	04.07.2034	63.493	0,68
113.000	Croatia Government International Bond*	1,50 %	17.06.2031	93.971	1,01
127.000	Estonia Government International Bond*	4,00 %	12.10.2032	130.391	1,40
25.555	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2052	13.753	0,15
180.381	French Republic Government Bond OAT*	1,25 %	25.05.2038	136.699	1,47
63.491	French Republic Government Bond OAT*	1,50 %	25.05.2031	57.177	0,62
54.000	French Republic Government Bond OAT*	1,50 %	25.05.2050	37.035	0,40
12.650	French Republic Government Bond OAT*	1,75 %	25.05.2066	8.695	0,09

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 43,09 % (31. Dezember 2021: 51,01 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
111.734	French Republic Government Bond OAT*	2,00 %	25.11.2032	101.969	1,10
21.000	Ireland Government Bond*	0,55 %	22.04.2041	13.228	0,14
55.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,00 %	01.08.2026	48.310	0,52
46.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,25 %	15.03.2028	38.028	0,41
85.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,20 %	15.08.2025	80.136	0,86
186.982	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40 %	26.05.2025	184.913	1,99
60.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,45 %	01.03.2036	41.318	0,44
136.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60 %	01.06.2026	127.225	1,37
63.017	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60 %	22.11.2028	60.453	0,65
169.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,75 %	30.05.2024	165.521	1,78
100.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,85 %	01.07.2025	96.152	1,03
62.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	2,05 %	01.08.2027	57.557	0,62
44.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	2,50 %	01.12.2032	36.841	0,40
125.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	3,00 %	01.08.2029	117.055	1,26
150.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	4,00 %	01.02.2037	140.248	1,51
51.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	0,35 %	22.06.2032	39.516	0,43
28.904	Kingdom of Belgium Government Bond*	0,40 %	22.06.2040	17.670	0,19
77.696	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,45 %	22.06.2037	61.137	0,66
53.000	Lithuania Government International Bond*	2,13 %	01.06.2032	46.377	0,50
157.000	Netherlands Government Bond*	4,00 %	15.01.2037	176.992	1,90
100.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	0,30 %	17.10.2031	76.787	0,83
340.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	1,65 %	16.07.2032	289.738	3,12
61.500	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	1,95 %	15.06.2029	57.458	0,62
110.000	Republic of Austria Government Bond*	0,90 %	20.02.2032	90.981	0,98
68.000	Romanian Government International Bond*	1,75 %	13.07.2030	47.467	0,51
113.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	75.807	0,82
52.000	Romanian Government International Bond**	2,88 %	26.05.2028	45.162	0,49
111.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	82.206	0,88
34.000	Slovakia Government Bond*	4,00 %	19.10.2032	35.054	0,38
65.267	SNCF Reseau*	2,45 %	28.02.2023	65.594	0,71
147.000	Spain Government Bond*	0,85 %	30.07.2037	98.042	1,05
42.000	Spain Government Bond*	1,45 %	31.10.2027	38.938	0,42
21.000	Spain Government Bond*	2,90 %	31.10.2046	18.101	0,19
71.000	Spain Government Bond*	4,20 %	31.01.2037	74.514	0,80
89.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,65 %	22.02.2038	72.345	0,78
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>4.005.023</b>	<b>43,09</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>8.547.015</b>	<b>91,95</b>

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,45 % (31. Dezember 2021: 0,25 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
(2)	Euro-BTP Future March 2023	4.460	0,05
(2)	Euro-Bund Future March 2023	17.730	0,19
5	Euro-Bund Put Option on Future February 2023, Strike Price EUR 136	13.642	0,15
(4)	Euro-Schatz Future March 2023	5.600	0,06
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>41.432</b>	<b>0,45</b>

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,18 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
EUR 250.000	23.09.2025	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	3,58 %	CPTFEMU	93	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten*</b>						<b>93</b>	<b>0,00</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.  
 (Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.  
<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2021: 0,03 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
EUR 106.000	07.10.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	2,72 %	1D EUROSTR	1.858	0,02
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>1.858</b>	<b>0,02</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.  
 (Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.  
<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>8.590.398</b>	<b>92,42</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Futures-Kontrakte (0,88 %) (31. Dezember 2021: (0,03 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
4	3-Month Euro EURIBOR Future December 2023	(18.750)	(0,20)
10	Euro-BOBL Future March 2023	(37.640)	(0,40)
1	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	(25.620)	(0,28)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(82.010)</b>	<b>(0,88)</b>

## Euro Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Zinsswap-Kontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))**

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
EUR	492.000	16.09.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,17 %	1D EUROSTR	(8.292)	(0,09)
EUR	200.031	30.08.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,22 %	6M EURIBOR	(15.617)	(0,17)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>							<b>(23.909)</b>	<b>(0,26)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.**Credit-Default-Swap-Kontrakten(0,07 %) (31. Dezember 2021: (0,95 %))**

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
EUR	600.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover S38	(6.528)	(0,07)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b>					<b>(6.528)</b>	<b>(0,07)</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(112.447)</b>	<b>(1,21)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>8.477.951</b>	<b>91,21</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>816.791</b>	<b>8,79</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>9.294.742</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	EUR	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	6.698.394	70,18
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.848.621	19,36
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(40.578)	(0,43)
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(28.486)	(0,30)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>8.477.951</b>	<b>88,81</b>

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens	
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,66 % (31. Dezember 2021: 0,57 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
250.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class E	10,51 %	15.05.2030	215.121	0,66
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>215.121</b>	<b>0,66</b>
<b>Unternehmensanleihen 98,80 % (31. Dezember 2021: 94,07 %)</b>					
<b>Euro</b>					
250.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	215.626	0,66
112.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	96.572	0,30
200.000	Adevinta ASA*	3,00 %	15.11.2027	177.625	0,55
400.000	Adient Global Holdings Ltd*	3,50 %	15.08.2024	384.893	1,19
200.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	169.872	0,52
222.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	201.307	0,62
100.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	81.163	0,25
100.000	Altice Finco SA*	4,75 %	15.01.2028	74.824	0,23
149.000	Altice France Holding SA*	4,00 %	15.02.2028	96.532	0,30
500.000	Altice France Holding SA*	8,00 %	15.05.2027	370.700	1,14
100.000	Altice France SA**	2,13 %	15.02.2025	88.750	0,27
150.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	114.944	0,35
200.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	192.500	0,59
200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	3,00 %	01.09.2029	147.005	0,45
320.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	274.130	0,84
160.000	Assemblin Financing AB**	7,05 %	15.05.2025	156.914	0,48
151.000	Autostrade per l'Italia SpA*	1,88 %	26.09.2029	120.328	0,37
150.000	Autostrade per l'Italia SpA*	2,00 %	04.12.2028	123.879	0,38
150.000	Avantor Funding Inc**	2,63 %	01.11.2025	141.930	0,44
250.000	Avantor Funding Inc*	3,88 %	15.07.2028	231.688	0,71
100.000	Avis Budget Finance Plc**	4,75 %	30.01.2026	93.769	0,29
100.000	Banijay Entertainment SASU**	3,50 %	01.03.2025	94.457	0,29
193.000	Banijay Group SAS**	6,50 %	01.03.2026	182.619	0,56
100.000	Bayer AG*	4,50 %	25.03.2082	91.444	0,28
400.000	Bayer AG*	5,38 %	25.03.2082	352.000	1,08
100.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	84.175	0,26
188.000	BCP V Modular Services Finance Plc**	6,75 %	30.11.2029	139.848	0,43
160.000	Belden Inc*	3,38 %	15.07.2027	147.212	0,45
100.000	Belden Inc*	3,88 %	15.03.2028	91.641	0,28
217.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25 %	30.04.2029	188.624	0,58
100.000	CAB SELAS**	3,38 %	01.02.2028	80.678	0,25
150.000	Canpack SA/Canpack US LLC*	2,38 %	01.11.2027	118.737	0,37
160.000	Castle UK Finco Plc**	7,01 %	15.05.2028	119.296	0,37
143.000	Castor SpA*	7,30 %	15.02.2029	139.133	0,43
150.000	Cedacri Mergesco SpA*	6,39 %	15.05.2028	139.842	0,43

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert % des Netto- EUR vermögens
<b>Unternehmensanleihen 98,80 % (31. Dezember 2021: 94,07 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Euro (Fortsetzung)</b>				
200.000	Celanese US Holdings LLC <sup>*</sup>	4,78 %	19.07.2026	190.826 0,59
100.000	Cellnex Finance Co SA <sup>*</sup>	1,50 %	08.06.2028	83.451 0,26
500.000	Cellnex Telecom SA <sup>*</sup>	1,75 %	23.10.2030	389.092 1,20
200.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH <sup>**</sup>	4,38 %	15.01.2028	176.358 0,54
100.000	Chrome Holdco SASU <sup>*</sup>	5,00 %	31.05.2029	78.050 0,24
100.000	Cirsa Finance International Sarl <sup>*</sup>	4,75 %	22.05.2025	94.896 0,29
250.000	Cirsa Finance International Sarl <sup>*</sup>	10,38 %	30.11.2027	256.868 0,79
180.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co <sup>**</sup>	4,38 %	15.05.2026	166.909 0,51
300.000	CMA CGM SA <sup>*</sup>	7,50 %	15.01.2026	311.100 0,96
302.000	Constellium SE <sup>*</sup>	3,13 %	15.07.2029	240.098 0,74
155.000	Coty Inc <sup>**</sup>	4,75 %	15.04.2026	146.087 0,45
120.000	Ctec II GmbH <sup>**</sup>	5,25 %	15.02.2030	100.320 0,31
200.000	Cullinan Holdco Scsp <sup>**</sup>	4,63 %	15.10.2026	175.843 0,54
200.000	Deutsche Lufthansa AG <sup>*</sup>	3,00 %	29.05.2026	181.173 0,56
270.000	DKT Finance ApS <sup>**</sup>	7,00 %	17.06.2023	269.073 0,83
160.000	Douglas GmbH <sup>*</sup>	6,00 %	08.04.2026	134.608 0,42
185.000	Dufry One BV <sup>**</sup>	2,00 %	15.02.2027	151.934 0,47
100.000	Dufry One BV <sup>*</sup>	3,38 %	15.04.2028	83.213 0,26
200.000	eG Global Finance Plc <sup>*</sup>	3,63 %	07.02.2024	190.263 0,59
150.000	eircom Finance DAC <sup>**</sup>	3,50 %	15.05.2026	135.815 0,42
400.000	Electricite de France SA <sup>*</sup>	5,00 %	29.12.2049	366.240 1,13
400.000	Electricite de France SA <sup>*</sup>	7,50 %	29.12.2049	399.496 1,23
264.000	Emeria SASU <sup>**</sup>	3,38 %	31.03.2028	220.783 0,68
100.000	Encore Capital Group Inc <sup>*</sup>	5,63 %	15.01.2028	94.775 0,29
280.000	Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC <sup>**</sup>	4,00 %	15.09.2025	275.189 0,85
200.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	2,38 %	15.06.2027	167.687 0,52
100.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	2,63 %	15.06.2025	91.312 0,28
167.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	2,75 %	15.02.2027	141.515 0,44
100.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	3,75 %	15.06.2028	85.342 0,26
100.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	7,25 %	15.06.2026	101.142 0,31
200.000	Fiber Bidco SpA <sup>*</sup>	11,00 %	25.10.2027	212.841 0,66
130.000	Food Service Project SA <sup>*</sup>	5,50 %	21.01.2027	120.692 0,37
181.000	Grifols Escrow Issuer SA <sup>*</sup>	3,88 %	15.10.2028	153.107 0,47
200.000	Gruenthal GmbH <sup>*</sup>	3,63 %	15.11.2026	183.726 0,57
200.000	Gruenthal GmbH <sup>**</sup>	4,13 %	15.05.2028	180.500 0,56
141.000	Guala Closures SpA <sup>*</sup>	3,25 %	15.06.2028	120.996 0,37
170.000	Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>	3,25 %	29.12.2049	125.459 0,39
200.000	Huhtamaki OYJ <sup>*</sup>	4,25 %	09.06.2027	195.849 0,60
200.000	IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>	3,63 %	15.05.2025	182.994 0,56
200.000	IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>	3,88 %	15.05.2027	169.730 0,52

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert % des Netto- EUR vermögens
<b>Unternehmensanleihen 98,80 % (31. Dezember 2021: 94,07 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Euro (Fortsetzung)</b>				
380.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	353.331 1,09
250.000	Iliad Holding SASU**	5,63 %	15.10.2028	227.559 0,70
100.000	iliad SA*	5,38 %	14.06.2027	99.578 0,31
100.000	INEOS Finance Plc*	2,13 %	15.11.2025	90.875 0,28
150.000	INEOS Finance Plc*	2,88 %	01.05.2026	129.748 0,40
100.000	INEOS Finance Plc*	3,38 %	31.03.2026	89.471 0,28
350.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc*	3,75 %	15.07.2026	289.405 0,89
100.000	Infineon Technologies AG*	3,63 %	29.12.2049	89.651 0,28
200.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	154.500 0,48
200.000	International Game Technology Plc*	3,50 %	15.06.2026	191.444 0,59
52.111	Intrum AB*	3,13 %	15.07.2024	50.378 0,16
100.000	Intrum AB*	3,50 %	15.07.2026	84.440 0,26
100.000	Intrum AB*	9,25 %	15.03.2028	99.125 0,31
160.000	IQVIA Inc**	2,88 %	15.06.2028	143.200 0,44
270.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	6,88 %	15.11.2026	240.840 0,74
200.000	Kaixo Bondco Telecom SA*	5,13 %	30.09.2029	171.000 0,53
136.000	Kapla Holding SAS*	3,38 %	15.12.2026	121.258 0,37
100.000	KION Group AG*	1,63 %	24.09.2025	89.168 0,28
100.000	Koninklijke KPN NV*	6,00 %	29.12.2049	100.063 0,31
285.000	Kronos International Inc**	3,75 %	15.09.2025	250.713 0,77
200.000	LeasePlan Corp NV*	7,38 %	29.12.2049	198.700 0,61
104.499	LHMC Finco 2 Sarl*	7,25 %	02.10.2025	90.669 0,28
150.000	Lincoln Financing Sarl**	6,01 %	01.04.2024	149.437 0,46
400.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	359.500 1,11
252.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	216.657 0,67
260.000	Matterhorn Telecom SA**	3,13 %	15.09.2026	236.263 0,73
200.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	4,75 %	15.04.2024	193.150 0,60
200.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	140.324 0,43
200.000	Mooney Group SpA**	5,94 %	17.12.2026	190.125 0,59
100.000	Motion Finco Sarl**	7,00 %	15.05.2025	100.112 0,31
115.000	NH Hotel Group SA*	4,00 %	02.07.2026	106.099 0,33
150.000	Nidda Healthcare Holding GmbH**	7,50 %	21.08.2026	143.711 0,44
100.000	Olympus Water US Holding Corp*	3,88 %	01.10.2028	81.493 0,25
100.000	Olympus Water US Holding Corp*	5,38 %	01.10.2029	72.926 0,23
290.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV*	2,88 %	30.04.2028	254.833 0,79
156.000	Paganini Bidco SpA*	5,89 %	30.10.2028	150.914 0,47
120.000	Paprec Holding SA**	3,50 %	01.07.2028	104.323 0,32
300.000	Petroleos Mexicanos*	4,75 %	26.02.2029	234.870 0,72
199.000	Petroleos Mexicanos*	4,88 %	21.02.2028	163.159 0,50
175.000	Picard Groupe SAS*	3,88 %	01.07.2026	150.376 0,46

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 98,80 % (31. Dezember 2021: 94,07 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
354.000	Playtech Plc*	4,25 %	07.03.2026	335.410	1,03
160.000	PrestigeBidCo GmbH**	7,38 %	15.07.2027	149.206	0,46
100.000	RCS & RDS SA*	2,50 %	05.02.2025	91.219	0,28
426.000	Repsol International Finance BV*	4,25 %	29.12.2049	381.244	1,18
150.000	Repsol International Finance BV*	4,50 %	25.03.2075	145.501	0,45
200.000	Rossini Sarl*	5,48 %	30.10.2025	197.625	0,61
200.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	1,00 %	12.08.2027	139.863	0,43
200.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,62 %	29.12.2049	79.072	0,24
156.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63 %	15.03.2028	134.550	0,41
100.000	Schaeffler AG*	3,38 %	12.10.2028	87.339	0,27
100.000	SES SA*	2,88 %	29.12.2049	80.130	0,25
150.000	SES SA*	5,63 %	29.12.2049	146.556	0,45
400.000	SGL Carbon SE*	4,63 %	30.09.2024	398.494	1,23
100.000	Sherwood Financing Plc**	6,39 %	15.11.2027	91.250	0,28
300.000	SPCM SA*	2,63 %	01.02.2029	252.375	0,78
130.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75 %	31.10.2026	111.312	0,34
400.000	Summit Properties Ltd*	2,00 %	31.01.2025	345.932	1,07
107.000	TeamSystem SpA*	3,50 %	15.02.2028	89.855	0,28
219.799	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	207.917	0,64
300.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	276.675	0,85
100.000	Telecom Italia Finance SA*	7,75 %	24.01.2033	105.850	0,33
100.000	Telecom Italia SpA*	2,38 %	12.10.2027	84.405	0,26
100.000	Telecom Italia SpA*	2,88 %	28.01.2026	91.386	0,28
200.000	Telefonica Europe BV*	2,88 %	29.12.2049	167.680	0,52
100.000	Telefonica Europe BV*	3,88 %	29.12.2049	90.902	0,28
300.000	Telefonica Europe BV*	4,38 %	29.12.2049	286.932	0,88
100.000	Telefonica Europe BV*	7,13 %	29.12.2049	102.387	0,32
140.000	Tendam Brands SAU*	8,97 %	31.03.2028	136.108	0,42
270.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63 %	15.10.2028	201.369	0,62
102.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,88 %	31.03.2027	82.370	0,25
350.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	4,38 %	09.05.2030	290.365	0,89
350.000	thyssenkrupp AG*	2,88 %	22.02.2024	347.155	1,07
194.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75 %	15.04.2029	144.026	0,44
208.000	Titan Holdings II BV*	5,13 %	15.07.2029	165.360	0,51
180.000	TK Elevator Holdco GmbH**	6,63 %	15.07.2028	149.577	0,46
100.000	TK Elevator Midco GmbH**	6,13 %	15.07.2027	97.225	0,30
300.000	TMNL Holding BV**	3,75 %	15.01.2029	263.612	0,81
100.000	Trivium Packaging Finance BV*	3,75 %	15.08.2026	91.744	0,28
200.000	UGI International LLC**	2,50 %	01.12.2029	153.942	0,47
155.000	United Group BV**	3,13 %	15.02.2026	125.046	0,39



## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 98,80 % (31. Dezember 2021: 94,07 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
150.000	United Group BV**	4,63 %	15.08.2028	111.030	0,34
100.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	72.425	0,22
150.000	UPC Holding BV*	3,88 %	15.06.2029	125.325	0,39
200.000	UPCB Finance VII Ltd*	3,63 %	15.06.2029	178.322	0,55
200.000	Veolia Environnement SA*	2,25 %	29.12.2049	178.889	0,55
400.000	Verisure Holding AB*	3,88 %	15.07.2026	363.503	1,12
236.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	189.390	0,58
100.000	Virgin Media Finance Plc**	3,75 %	15.07.2030	77.245	0,24
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,00 %	08.08.2024	78.205	0,24
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,50 %	01.11.2025	75.132	0,23
100.000	Vodafone Group Plc*	4,20 %	03.10.2078	91.000	0,28
200.000	WEPA Hygieneprodukte GmbH**	2,88 %	15.12.2027	164.018	0,51
200.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	153.485	0,47
300.000	ZF Finance GmbH*	3,00 %	21.09.2025	277.086	0,85
100.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	84.342	0,26
175.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	127.111	0,39
<b>Euro insgesamt</b>				<b>28.338.871</b>	<b>87,32</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
169.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	152.902	0,47
200.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	156.226	0,48
150.000	B&M European Value Retail SA*	3,63 %	15.07.2025	158.076	0,49
200.000	Bellis Acquisition Co Plc**	3,25 %	16.02.2026	184.253	0,57
120.000	Castle UK Finco Plc**	7,00 %	15.05.2029	94.972	0,29
250.000	Centrica Plc*	5,25 %	10.04.2075	259.607	0,80
100.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	103.885	0,32
100.000	Encore Capital Group Inc*	5,38 %	15.02.2026	101.496	0,31
202.000	Maison Finco Plc**	6,00 %	31.10.2027	166.806	0,51
160.000	Marks & Spencer Plc*	3,75 %	19.05.2026	157.631	0,49
100.000	National Express Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	93.521	0,29
150.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	160.274	0,49
150.000	Pinewood Finance Co Ltd**	3,25 %	30.09.2025	156.428	0,48
162.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38 %	15.02.2025	159.140	0,49
140.000	Premier Foods Finance Plc*	3,50 %	15.10.2026	139.100	0,43
190.000	RAC Bond Co Plc**	5,25 %	04.11.2027	170.187	0,52
111.000	Sherwood Financing Plc**	6,00 %	15.11.2026	97.584	0,30
100.000	Travis Perkins Plc*	3,75 %	17.02.2026	100.129	0,31
100.000	Travis Perkins Plc*	4,50 %	07.09.2023	111.332	0,34
150.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	4,25 %	15.01.2030	131.909	0,41
100.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	5,00 %	15.04.2027	100.661	0,31

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 98,80 % (31. Dezember 2021: 94,07 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>					
300.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	274.212	0,85
200.000	Vodafone Group Plc*	4,88 %	03.10.2078	211.714	0,65
162.000	Voyage Care BondCo Plc**	5,88 %	15.02.2027	155.030	0,48
146.000	Zenith Finco Plc**	6,50 %	30.06.2027	129.054	0,40
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>3.726.129</b>	<b>11,48</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>32.065.000</b>	<b>98,80</b>
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,63 % (31. Dezember 2021: 0,54 %)</b>					
<b>Euro</b>					
94.016	Aernnova Aerospace SAU	5,44 %	26.02.2027	85.178	0,26
24.107	Aernnova Aerospace SAU	5,63 %	26.02.2027	21.841	0,07
100.000	Rain Carbon Inc	3,28 %	16.01.2025	95.500	0,30
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt +</b>				<b>202.519</b>	<b>0,63</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>32.482.640</b>	<b>100,09</b>

Devisenterminkontrakte 3,87 % (31. Dezember 2021: 2,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
4.529.258 €	4.006.600 £	18.01.2023	UBS AG	1	16.188	0,05
265.482 €	263.057 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	19.250	0,06
184.163 €	159.712 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	4.262	0,01
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
89.058 €	126.994 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	13	398	0,00
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
239.198 €	234.105 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	20.066	0,06
17.407.979 €	17.317.200 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	1.198.380	3,69
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ~</b>					<b>1.258.544</b>	<b>3,87</b>

	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>33.741.184</b>	<b>103,96</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (9,59 %) (31. Dezember 2021: (0,82 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
3.599 SGD	2.533 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(19)	(0,00)
118 SGD	82 €	18.01.2023	UBS AG	1	0	(0,00)

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (9,59 %) (31. Dezember 2021: (0,82 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i>						
123.278 SGD	87.114 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(1.049)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
773.408 US\$	762.996 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(39.055)	(0,12)
482.289 US\$	468.372 €	18.01.2023	UBS AG	2	(16.930)	(0,05)
43.969.629 US\$	44.213.312 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	13	(3.055.966)	(9,42)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(3.113.019)</b>	<b>(9,59)</b>

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(3.113.019)</b>	<b>(9,59)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>30.628.165</b>	<b>94,37</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>1.826.363</b>	<b>5,63</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>32.454.528</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	EUR	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	21.940.846	44,45
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	10.339.275	20,95
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	202.519	0,41
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(1.854.475)	(3,76)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>30.628.165</b>	<b>62,05</b>

## European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens	
<b>Aktien 99,17 % (31. Dezember 2021: 96,95 %)</b>			
<b>Dänische Krone</b>			
68.148	Novo Nordisk A/S Class B	8.595.893	4,89
<b>Dänische Krone insgesamt</b>		<b>8.595.893</b>	<b>4,89</b>
<b>Euro</b>			
4.186	Adyen NV	5.393.242	3,07
66.131	Alfen Beheer BV	5.568.230	3,17
77.311	Amundi SA	4.097.483	2,33
17.410	ASML Holding NV	8.771.158	4,99
33.962	Beiersdorf AG	3.640.726	2,07
123.830	Cellnex Telecom SA	3.828.824	2,18
102.609	Euronext NV	7.096.439	4,03
233.131	HelloFresh SE	4.786.180	2,72
17.362	Kering SA	8.255.631	4,69
10.077	L'Oreal SA	3.361.687	1,91
70.143	RELX Plc	1.812.495	1,03
19.596	Sartorius Stedim Biotech	5.927.790	3,37
52.967	Schneider Electric SE	6.923.846	3,94
102.969	Scout24 SE	4.832.335	2,75
228.722	TeamViewer AG	2.754.957	1,57
149.322	Zalando SE	4.944.051	2,81
<b>Euro insgesamt</b>		<b>81.995.074</b>	<b>46,63</b>
<b>Norwegische Krone</b>			
121.746	Bakkafrost P/F	7.133.274	4,06
<b>Norwegische Krone insgesamt</b>		<b>7.133.274</b>	<b>4,06</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
647.374	3i Group Plc	9.788.345	5,57
194.030	CVS Group Plc	4.233.871	2,41
124.114	Dechra Pharmaceuticals Plc	3.662.299	2,08
84.046	London Stock Exchange Group Plc	6.759.821	3,84
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>24.444.336</b>	<b>13,90</b>
<b>Schwedische Krone</b>			
340.264	Assa Abloy AB Class B	6.844.928	3,89
625.899	Atlas Copco AB Class A	6.928.660	3,94
<b>Schwedische Krone insgesamt</b>		<b>13.773.588</b>	<b>7,83</b>
<b>Schweizer Franken</b>			
88.863	Nestle SA	9.642.082	5,48

## European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 99,17 % (31. Dezember 2021: 96,95 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweizer Franken (Fortsetzung)</b>			
8.370	Partners Group Holding AG	6.923.718	3,94
57.286	Straumann Holding AG	6.126.474	3,48
19.428	Tecan Group AG	8.114.186	4,62
18.064	VAT Group AG	4.624.760	2,63
	<b>Schweizer Franken insgesamt</b>	<b>35.431.220</b>	<b>20,15</b>
<b>US-Dollar</b>			
11.361	SolarEdge Technologies Inc	3.015.442	1,71
	<b>US-Dollar insgesamt</b>	<b>3.015.442</b>	<b>1,71</b>
	<b>Aktien insgesamt *</b>	<b>174.388.827</b>	<b>99,17</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>174.388.827</b>	<b>99,17</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>174.388.827</b>	<b>99,17</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>		<b>174.388.827</b>	<b>99,17</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>		<b>1.465.403</b>	<b>0,83</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>175.854.230</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>EUR</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind		174.388.827	96,32
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>174.388.827</b>	<b>96,32</b>

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Schatzwechsel 81,61 %</b>					
<b>US-Dollar</b>					
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	03.01.2023	2.800.000	6,76
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	10.01.2023	2.798.033	6,75
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	17.01.2023	2.796.000	6,75
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	24.01.2023	2.793.735	6,74
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	02.02.2023	2.791.128	6,73
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.02.2023	2.788.844	6,73
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.02.2023	2.786.093	6,72
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.02.2023	2.783.169	6,72
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	02.03.2023	2.780.901	6,71
2.800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.03.2023	2.778.573	6,70
3.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.03.2023	2.972.110	7,17
3.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	04.05.2023	2.954.768	7,13
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>33.823.354</b>	<b>81,61</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>33.823.354</b>	<b>81,61</b>

### Devisenterminkontrakte (2,21 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
22.510.666 £	26.171.108 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	917.704	2,21
161.311 US\$	133.745 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	365	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>918.069</b>	<b>2,21</b>

### Total Return Swap-Kontrakte 0,04 %

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
USD 38.432.156	26.10.2024	0,25 <sup>1</sup>	Alphas Managed Accounts Platform CXIV Limited <sup>2</sup>	18.364	0,04
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>18.364</b>	<b>0,04</b>

<sup>1</sup> Fester Zinssatz.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>34.759.787</b>	<b>83,86</b>

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,04 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
1.634.133 £	1.985.093 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(18.616)	(0,04)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(18.616)</b>	<b>(0,04)</b>
					<b>Zeitwert</b>	<b>% des Nettovermögens</b>
					<b>US\$</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(18.616)</b>	<b>(0,04)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>34.741.171</b>	<b>83,82</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>6.705.501</b>	<b>16,18</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>41.446.672</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>					<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden					33.823.354	81,23
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente					917.817	2,20
<b>Anlagen insgesamt</b>					<b>34.741.171</b>	<b>83,43</b>

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Schatzwechsel 0,59 % (31. Dezember 2021: 0,78 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
800.000	United States Treasury Bill	0,00 %	30.03.2023	791.814	0,59
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>791.814</b>	<b>0,59</b>
<b>Agency Bonds 1,80 % (31. Dezember 2021: 1,55 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
540.000	Federal Home Loan Banks*	5,50 %	15.07.2036	593.652	0,44
265.000	Federal Home Loan Mortgage Corp**	0,38 %	23.09.2025	238.532	0,18
300.000	Federal National Mortgage Association**	0,50 %	07.11.2025	269.851	0,20
835.000	Federal National Mortgage Association**	0,75 %	08.10.2027	719.462	0,53
640.000	Federal National Mortgage Association**	0,88 %	05.08.2030	508.391	0,38
85.000	Tennessee Valley Authority*	5,88 %	01.04.2036	93.302	0,07
<b>Agency Bonds insgesamt</b>				<b>2.423.190</b>	<b>1,80</b>
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 6,57 % (31. Dezember 2021: 8,76 %)</b>					
<b>Euro</b>					
100.000	Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A	2,23 %	28.03.2057	105.353	0,08
213.901	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	4,89 %	24.02.2058	216.906	0,16
399.918	Last Mile Securities - PE 2021 DAC Series 2021-1X Class A2	2,85 %	17.08.2031	398.176	0,29
167.726	LT Autorahoitus III DAC Series 3 Class A	2,87 %	17.12.2032	179.585	0,13
681.646	Primrose Residential Series 2021-1 Class A	2,75 %	24.03.2061	712.008	0,53
600.000	Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class C	3,90 %	24.01.2061	616.535	0,46
<b>Euro insgesamt</b>				<b>2.228.563</b>	<b>1,65</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
200.000	Gemgarto 2021-1 Plc Series 2021-1X Class B	4,51 %	16.12.2067	234.561	0,17
120.000	Mortimer BTL 2021-1 Plc Series 2021-1 Class C	4,89 %	23.06.2053	134.963	0,10
300.000	Sage AR Funding No 1 Plc Series 1X Class A	4,50 %	17.11.2030	345.479	0,26
283.701	Together Asset Backed Securitisation Series 2021-CRE1 Class A	4,83 %	20.01.2055	338.377	0,25
200.000	Tower Bridge Funding 2021-1 Plc Series 2021-1 Class B	4,94 %	21.07.2064	236.519	0,18
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>1.289.899</b>	<b>0,96</b>
<b>US-Dollar</b>					
1.086.247	CD 2017-CD6 Mortgage Trust Class ASB	3,33 %	13.11.2050	1.033.221	0,77
1.031.360	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA	1,31 %	10.02.2048	21.099	0,02
305.000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust Class AM	4,43 %	10.02.2047	296.837	0,22
1.831.068	COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA	0,95 %	10.05.2047	16.365	0,01
1.958.388	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA	1,05 %	10.04.2047	16.617	0,01



## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 6,57 % (31. Dezember 2021: 8,76 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
67.330	COMM 2014-UBS2 Mortgage Trust Class ASB	3,47 %	10.03.2047	66.409	0,05
1.618.707	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA	1,06 %	10.06.2047	16.146	0,01
586.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2	5,83 %	25.12.2041	557.346	0,41
2.381.546	CSAIL 2015-C2 Commercial Mortgage Trust Class XA	0,72 %	15.06.2057	29.957	0,02
505.000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust Class A4	4,22 %	15.08.2051	476.292	0,35
497.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1	7,94 %	25.07.2030	506.487	0,38
429.793	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	11,14 %	25.08.2028	449.019	0,33
595.001	Fannie Mae REMICS Class HS	1,61 %	25.07.2042	67.269	0,05
359.969	Fannie Mae REMICS Class PI	3,50 %	25.12.2042	59.740	0,04
639.210	Fannie Mae REMICS Class SA	1,46 %	25.07.2046	64.277	0,05
644.493	Freddie Mac REMICS Class HS	2,13 %	15.03.2042	78.121	0,06
630.076	Freddie Mac REMICS Class SA	1,73 %	15.04.2046	65.886	0,05
1.220.213	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1A	6,03 %	25.03.2042	1.205.185	0,89
409.393	Freddie Mac Strips Class S1	1,63 %	15.09.2043	41.495	0,03
1.013.866	Government National Mortgage Association Class AI	2,00 %	20.02.2051	111.822	0,08
533.887	Government National Mortgage Association Class IT	3,50 %	20.02.2043	97.374	0,07
1.144.557	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA	1,02 %	10.01.2047	8.051	0,01
2.589.657	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA	0,73 %	10.05.2050	35.818	0,03
1.730.364	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA	1,00 %	15.08.2047	22.412	0,02
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>5.343.245</b>	<b>3,96</b>
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>8.861.707</b>	<b>6,57</b>
<b>Unternehmensanleihen 32,90 % (31. Dezember 2021: 29,36 %)</b>					
<b>Kanadischer Dollar</b>					
200.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc <sup>†</sup>	4,32 %	15.05.2047	124.375	0,09
330.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada <sup>†</sup>	2,20 %	29.05.2028	213.048	0,16
330.000	General Motors Financial of Canada Ltd <sup>†</sup>	1,75 %	15.04.2026	214.808	0,16
200.000	John Deere Financial Inc <sup>†</sup>	1,34 %	08.09.2027	127.193	0,10
330.000	Verizon Communications Inc <sup>†</sup>	2,50 %	16.05.2030	206.238	0,15
200.000	Walt Disney Co <sup>*</sup>	3,06 %	30.03.2027	137.246	0,10
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>				<b>1.022.908</b>	<b>0,76</b>
<b>Euro</b>					
301.000	American Tower Corp <sup>*</sup>	0,50 %	15.01.2028	264.564	0,20
130.000	American Tower Corp <sup>*</sup>	0,88 %	21.05.2029	110.876	0,08
280.000	Apple Inc <sup>*</sup>	2,00 %	17.09.2027	285.320	0,21
635.000	AT&T Inc <sup>*</sup>	2,40 %	15.03.2024	669.593	0,50
200.000	AT&T Inc <sup>*</sup>	2,45 %	15.03.2035	174.217	0,13
606.000	Athene Global Funding <sup>*</sup>	0,37 %	10.09.2026	547.506	0,41

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 32,90 % (31. Dezember 2021: 29,36 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
275.000	Bank of America Corp*	2,82 %	27.04.2033	256.587	0,19
219.000	Barclays Plc*	0,58 %	09.08.2029	184.696	0,14
200.000	BPCE SA*	4,00 %	29.11.2032	209.405	0,16
266.000	Comcast Corp*	0,75 %	20.02.2032	217.482	0,16
315.000	Credit Suisse Group AG*	7,75 %	01.03.2029	335.585	0,25
300.000	DH Europe Finance II Sarl*	0,75 %	18.09.2031	251.412	0,19
307.000	Digital Dutch Finco BV*	1,00 %	15.01.2032	230.741	0,17
200.000	EnBW International Finance BV*	4,05 %	22.11.2029	213.282	0,16
1.000.000	European Union*	0,00 %	04.07.2031	824.931	0,61
302.000	European Union*	0,40 %	04.02.2037	219.594	0,16
170.000	European Union*	0,45 %	04.07.2041	111.165	0,08
562.000	European Union*	1,00 %	06.07.2032	495.875	0,37
388.000	General Motors Financial Co Inc*	0,85 %	26.02.2026	371.014	0,28
395.000	General Motors Financial Co Inc*	0,96 %	07.09.2023	415.680	0,31
197.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,25 %	13.10.2024	186.269	0,14
150.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,38 %	24.07.2028	120.563	0,09
200.000	ING Groep NV*	4,88 %	14.11.2027	217.455	0,16
135.000	Liberty Mutual Group Inc*	4,63 %	02.12.2030	138.100	0,10
137.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,13 %	24.08.2030	134.018	0,10
100.000	Medtronic Global Holdings SCA*	1,38 %	15.10.2040	70.064	0,05
150.000	Molson Coors Beverage Co*	1,25 %	15.07.2024	154.698	0,11
265.000	Morgan Stanley*	1,75 %	30.01.2025	272.821	0,20
185.000	Morgan Stanley*	5,15 %	25.01.2034	205.055	0,15
100.000	National Grid North America Inc*	1,00 %	12.07.2024	102.405	0,08
123.000	Nationwide Building Society*	3,25 %	05.09.2029	123.966	0,09
153.000	Nordea Bank Abp*	0,63 %	18.08.2031	140.444	0,10
100.000	Suez SACA*	5,00 %	03.11.2032	109.920	0,08
277.000	Toronto-Dominion Bank*	3,63 %	13.12.2029	285.715	0,21
330.000	UBS Group AG*	1,25 %	01.09.2026	318.044	0,24
200.000	Upjohn Finance BV*	1,91 %	23.06.2032	164.502	0,12
229.000	Verizon Communications Inc*	0,75 %	22.03.2032	183.601	0,14
100.000	Verizon Communications Inc*	4,25 %	31.10.2030	108.396	0,08
400.000	Volkswagen Bank GmbH*	1,25 %	10.06.2024	410.214	0,30
200.000	Vonovia SE*	0,75 %	01.09.2032	142.610	0,11
100.000	Westlake Corp*	1,63 %	17.07.2029	86.654	0,06
305.000	Westpac Banking Corp*	0,77 %	13.05.2031	276.280	0,20
<b>Euro insgesamt</b>				<b>10.341.319</b>	<b>7,67</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
60.000	Anglo American Capital Plc*	3,38 %	11.03.2029	62.683	0,05

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 32,90 % (31. Dezember 2021: 29,36 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>					
300.000	Banco Santander SA <sup>*</sup>	2,25 %	04.10.2032	291.133	0,21
200.000	Credit Suisse Group AG <sup>*</sup>	2,13 %	15.11.2029	171.551	0,13
129.000	Enel Finance International NV <sup>*</sup>	5,63 %	14.08.2024	156.634	0,12
170.000	Legal & General Group Plc <sup>*</sup>	4,50 %	01.11.2050	177.340	0,13
200.000	Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>	2,71 %	03.12.2035	178.911	0,13
210.000	National Grid Gas Plc <sup>*</sup>	1,38 %	07.02.2031	184.716	0,14
265.000	Principality Building Society <sup>*</sup>	2,38 %	23.11.2023	309.331	0,23
200.000	Volkswagen Financial Services NV <sup>*</sup>	4,25 %	09.10.2025	231.007	0,17
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>1.763.306</b>	<b>1,31</b>
<b>US-Dollar</b>					
805.000	AbbVie Inc <sup>*</sup>	2,95 %	21.11.2026	749.763	0,56
375.000	AbbVie Inc <sup>**</sup>	3,80 %	15.03.2025	365.796	0,27
150.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup>	3,00 %	29.10.2028	125.938	0,09
490.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup>	3,30 %	30.01.2032	384.261	0,29
205.000	Amazon.com Inc <sup>**</sup>	3,10 %	12.05.2051	147.026	0,11
205.000	American Tower Corp <sup>*</sup>	2,40 %	15.03.2025	193.027	0,14
549.000	American Tower Corp <sup>*</sup>	3,65 %	15.03.2027	513.573	0,38
570.000	Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc <sup>*</sup>	4,70 %	01.02.2036	540.485	0,40
125.000	Apple Inc <sup>**</sup>	3,35 %	09.02.2027	119.703	0,09
70.000	Asian Development Bank <sup>*</sup>	3,13 %	20.08.2027	66.918	0,05
70.000	AT&T Inc <sup>*</sup>	3,50 %	01.06.2041	52.474	0,04
329.000	AT&T Inc <sup>**</sup>	3,50 %	15.09.2053	223.534	0,17
650.000	AT&T Inc <sup>**</sup>	4,96 %	25.03.2024	647.097	0,48
200.000	Banco Santander SA <sup>*</sup>	2,75 %	03.12.2030	153.616	0,11
400.000	Banco Santander SA <sup>*</sup>	5,29 %	18.08.2027	391.201	0,29
485.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	1,84 %	04.02.2025	465.208	0,35
270.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	2,30 %	21.07.2032	208.578	0,16
595.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	2,59 %	29.04.2031	485.896	0,36
215.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	3,71 %	24.04.2028	199.284	0,15
470.000	Bank of America Corp <sup>*</sup>	4,45 %	03.03.2026	461.097	0,34
145.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	4,57 %	27.04.2033	133.042	0,10
650.000	Baxter International Inc <sup>**</sup>	4,65 %	29.11.2024	637.891	0,47
165.000	BNP Paribas SA <sup>**</sup>	3,50 %	01.03.2023	164.605	0,12
219.000	Boeing Co <sup>*</sup>	5,04 %	01.05.2027	216.933	0,16
75.000	Boeing Co <sup>*</sup>	5,71 %	01.05.2040	71.839	0,05
375.000	Boeing Co <sup>*</sup>	5,81 %	01.05.2050	349.602	0,26
170.000	Bristol-Myers Squibb Co <sup>*</sup>	2,95 %	15.03.2032	148.380	0,11
65.000	Bristol-Myers Squibb Co <sup>*</sup>	3,55 %	15.03.2042	53.046	0,04
32.000	Broadcom Inc <sup>**</sup>	3,15 %	15.11.2025	30.346	0,02

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 32,90 % (31. Dezember 2021: 29,36 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
115.000	Capital One Financial Corp <sup>*</sup>	3,20 %	30.01.2023	115.000	0,09
55.000	Carrier Global Corp <sup>**</sup>	2,49 %	15.02.2027	49.657	0,04
650.000	Caterpillar Financial Services Corp <sup>**</sup>	4,56 %	13.09.2024	645.833	0,48
260.000	CDW LLC/CDW Finance Corp <sup>**</sup>	2,67 %	01.12.2026	231.320	0,17
135.000	CDW LLC/CDW Finance Corp <sup>**</sup>	3,28 %	01.12.2028	115.835	0,09
280.000	CDW LLC/CDW Finance Corp <sup>**</sup>	3,57 %	01.12.2031	231.255	0,17
365.000	Cigna Corp <sup>*</sup>	2,40 %	15.03.2030	306.591	0,23
264.000	Cigna Corp <sup>*</sup>	3,75 %	15.07.2023	262.314	0,19
295.000	Citigroup Inc <sup>**</sup>	3,29 %	17.03.2026	280.657	0,21
295.000	Citigroup Inc <sup>**</sup>	3,35 %	24.04.2025	286.205	0,21
115.000	Citigroup Inc <sup>**</sup>	3,89 %	10.01.2028	107.627	0,08
145.000	Comcast Corp <sup>**</sup>	2,35 %	15.01.2027	131.954	0,10
430.000	Corp Andina de Fomento <sup>*</sup>	2,25 %	08.02.2027	385.528	0,29
250.000	Credit Suisse Group AG <sup>**</sup>	6,54 %	12.08.2033	219.974	0,16
250.000	Credit Suisse Group AG <sup>**</sup>	9,02 %	15.11.2033	256.662	0,19
80.000	Crown Castle Inc <sup>*</sup>	1,05 %	15.07.2026	69.218	0,05
260.000	CVS Health Corp <sup>*</sup>	1,75 %	21.08.2030	205.497	0,15
150.000	CVS Health Corp <sup>*</sup>	3,00 %	15.08.2026	140.304	0,10
90.000	Dell International LLC/EMC Corp <sup>*</sup>	6,02 %	15.06.2026	91.925	0,07
295.000	Diamondback Energy Inc <sup>**</sup>	3,13 %	24.03.2031	244.993	0,18
290.000	Diamondback Energy Inc <sup>**</sup>	6,25 %	15.03.2033	295.245	0,22
310.000	Dominion Energy Inc <sup>*</sup>	4,35 %	15.08.2032	289.092	0,21
260.000	Dominion Energy Inc <sup>*</sup>	5,38 %	15.11.2032	258.524	0,19
135.000	DTE Energy Co <sup>*</sup>	1,05 %	01.06.2025	122.397	0,09
260.000	Enbridge Inc <sup>*</sup>	2,50 %	14.02.2025	245.503	0,18
495.000	Entergy Texas Inc <sup>*</sup>	1,75 %	15.03.2031	387.157	0,29
145.000	EPR Properties <sup>**</sup>	3,60 %	15.11.2031	105.366	0,08
85.000	European Investment Bank <sup>*</sup>	3,25 %	15.11.2027	81.757	0,06
60.000	Evergy Inc <sup>*</sup>	2,45 %	15.09.2024	57.001	0,04
175.000	General Motors Co <sup>*</sup>	6,80 %	01.10.2027	181.944	0,14
315.000	General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>	3,80 %	07.04.2025	304.338	0,23
485.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	1,76 %	24.01.2025	464.417	0,34
310.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	1,99 %	27.01.2032	236.872	0,18
505.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	3,27 %	29.09.2025	486.969	0,36
650.000	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC <sup>*</sup>	5,21 %	24.03.2024	647.892	0,48
105.000	Hess Corp <sup>*</sup>	5,60 %	15.02.2041	99.713	0,07
160.000	Home Depot Inc <sup>*</sup>	4,95 %	15.09.2052	154.552	0,11
150.000	Illumina Inc <sup>**</sup>	5,75 %	13.12.2027	152.135	0,11
890.000	Inter-American Development Bank <sup>*</sup>	1,13 %	13.01.2031	711.723	0,53
240.000	International Finance Corp <sup>*</sup>	3,63 %	15.09.2025	235.518	0,18

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 32,90 % (31. Dezember 2021: 29,36 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
100.000	Interstate Power & Light Co**	2,30 %	01.06.2030	81.953	0,06
470.000	Intesa Sanpaolo SpA**	8,25 %	21.11.2033	478.148	0,36
515.000	JPMorgan Chase & Co**	1,56 %	10.12.2025	477.171	0,35
115.000	JPMorgan Chase & Co**	2,53 %	19.11.2041	75.598	0,06
145.000	JPMorgan Chase & Co**	2,74 %	15.10.2030	121.905	0,09
950.000	JPMorgan Chase & Co**	3,22 %	01.03.2025	923.770	0,69
100.000	Kinder Morgan Inc*	5,55 %	01.06.2045	91.649	0,07
300.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	3,00 %	20.05.2027	286.373	0,21
85.000	Lockheed Martin Corp*	5,25 %	15.01.2033	87.917	0,07
145.000	Lockheed Martin Corp*	5,90 %	15.11.2063	156.719	0,12
160.000	Magellan Midstream Partners LP*	3,25 %	01.06.2030	139.948	0,10
525.000	Marathon Petroleum Corp*	4,70 %	01.05.2025	517.442	0,38
245.000	Marvell Technology Inc**	2,45 %	15.04.2028	207.795	0,15
210.000	Marvell Technology Inc**	2,95 %	15.04.2031	169.411	0,13
55.000	Merck & Co Inc*	2,90 %	10.12.2061	35.233	0,03
60.000	Merck & Co Inc*	3,90 %	07.03.2039	52.909	0,04
173.000	Meta Platforms Inc*	4,45 %	15.08.2052	139.407	0,10
255.000	Micron Technology Inc**	2,70 %	15.04.2032	191.294	0,14
320.000	Morgan Stanley**	2,24 %	21.07.2032	246.269	0,18
175.000	Morgan Stanley**	2,72 %	22.07.2025	167.407	0,12
200.000	Morgan Stanley*	3,63 %	20.01.2027	188.894	0,14
105.000	Morgan Stanley**	5,30 %	20.04.2037	96.294	0,07
115.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc**	1,90 %	15.06.2028	98.389	0,07
210.000	NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc**	5,00 %	15.01.2033	198.962	0,15
27.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.07.2046	19.787	0,01
280.000	Oracle Corp*	6,90 %	09.11.2052	301.186	0,22
125.000	Phillips 66*	1,30 %	15.02.2026	112.122	0,08
223.000	Pioneer Natural Resources Co*	2,15 %	15.01.2031	176.785	0,13
345.000	QUALCOMM Inc**	6,00 %	20.05.2053	368.608	0,27
205.000	Roche Holdings Inc**	2,61 %	13.12.2051	133.740	0,10
650.000	Roche Holdings Inc**	4,84 %	10.03.2025	646.982	0,48
195.000	Royal Bank of Canada**	3,38 %	14.04.2025	188.603	0,14
695.000	SBA Tower Trust†	2,59 %	15.10.2056	535.633	0,40
255.000	Societe Generale SA**	1,49 %	14.12.2026	221.896	0,16
136.000	South32 Treasury Ltd**	4,35 %	14.04.2032	116.727	0,09
175.000	Southern Co Gas Capital Corp*	1,75 %	15.01.2031	134.553	0,10
555.000	Starbucks Corp**	2,55 %	15.11.2030	467.983	0,35
120.000	Stryker Corp*	0,60 %	01.12.2023	115.295	0,09
140.000	T-Mobile USA Inc*	2,05 %	15.02.2028	120.475	0,09
205.000	T-Mobile USA Inc*	2,55 %	15.02.2031	167.966	0,12

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 32,90 % (31. Dezember 2021: 29,36 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
240.000	T-Mobile USA Inc**	3,38 %	15.04.2029	211.847	0,16
305.000	T-Mobile USA Inc*	3,88 %	15.04.2030	276.989	0,21
175.000	T-Mobile USA Inc*	4,38 %	15.04.2040	150.064	0,11
270.000	UBS Group AG**	4,75 %	12.05.2028	258.801	0,19
310.000	Ventas Realty LP*	3,50 %	15.04.2024	301.691	0,22
420.000	Verizon Communications Inc**	2,36 %	15.03.2032	334.046	0,25
55.000	Verizon Communications Inc*	2,65 %	20.11.2040	37.327	0,03
60.000	Verizon Communications Inc*	3,70 %	22.03.2061	42.146	0,03
650.000	Verizon Communications Inc**	4,82 %	22.03.2024	645.134	0,48
155.000	Viatris Inc**	4,00 %	22.06.2050	96.037	0,07
110.000	Volkswagen Group of America Finance LLC**	3,75 %	13.05.2030	96.916	0,07
445.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,05 %	15.03.2042	342.038	0,25
525.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,14 %	15.03.2052	383.684	0,28
400.000	WEC Energy Group Inc*	5,15 %	01.10.2027	405.007	0,30
265.000	Westpac Banking Corp**	2,67 %	15.11.2035	197.515	0,15
200.000	Wisconsin Electric Power Co*	4,75 %	30.09.2032	196.598	0,15
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>31.231.661</b>	<b>23,16</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>44.359.194</b>	<b>32,90</b>
<b>Staatsanleihen 39,81 % (31. Dezember 2021: 45,56 %)</b>					
<b>Australischer Dollar</b>					
18.000	Australia Government Bond*	3,00 %	21.03.2047	9.709	0,01
<b>Australischer Dollar insgesamt</b>				<b>9.709</b>	<b>0,01</b>
<b>Kanadischer Dollar</b>					
890.000	Canadian Government Bond*	2,00 %	01.12.2051	499.383	0,37
960.000	Canadian Government Bond*	2,25 %	01.06.2029	667.154	0,49
7.908.000	Canadian Government Bond*	3,00 %	01.11.2024	5.728.977	4,25
4.216.890	Canadian Government Real Return Bond**	4,25 %	01.12.2026	3.434.324	2,55
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>				<b>10.329.838</b>	<b>7,66</b>
<b>Euro</b>					
240.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2052	125.964	0,09
1.395.573	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,25 %	15.02.2027	1.362.184	1,01
596.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	1,70 %	15.08.2032	592.645	0,44
348.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	3,25 %	04.07.2042	411.599	0,31
700.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	5,63 %	04.01.2028	855.433	0,63
153.000	French Republic Government Bond OAT*	0,50 %	25.05.2040	103.717	0,08
334.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2052	188.993	0,14
173.000	French Republic Government Bond OAT*	2,00 %	25.05.2048	143.193	0,11

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 39,81 % (31. Dezember 2021: 45,56 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
348.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	3,25 %	04.07.2042	411.599	0,31
700.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	5,63 %	04.01.2028	855.433	0,63
153.000	French Republic Government Bond OAT*	0,50 %	25.05.2040	103.717	0,08
334.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2052	188.993	0,14
173.000	French Republic Government Bond OAT*	2,00 %	25.05.2048	143.193	0,11
828.000	Ireland Government Bond*	1,10 %	15.05.2029	793.717	0,59
545.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,95 %	01.03.2037	362.740	0,27
134.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,70 %	01.09.2051	79.552	0,06
242.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,45 %	01.03.2048	211.345	0,15
270.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,45 %	22.06.2037	226.873	0,17
342.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,60 %	22.06.2047	260.996	0,19
564.000	Netherlands Government Bond*	0,00 %	15.01.2029	510.617	0,38
886.460	Netherlands Government Bond*	2,50 %	15.01.2033	918.335	0,68
529.000	Republic of Austria Government Bond*	0,00 %	20.02.2031	440.597	0,33
769.000	Republic of Austria Government Bond*	0,50 %	20.04.2027	744.045	0,55
308.000	Republic of Austria Government Bond*	0,75 %	20.03.2051	189.890	0,14
30.000	Spain Government Bond*	0,35 %	30.07.2023	31.655	0,02
536.000	Spain Government Bond**	1,95 %	30.07.2030	520.104	0,39
371.000	Spain Government Bond*	2,70 %	31.10.2048	323.744	0,24
<b>Euro insgesamt</b>				<b>9.397.938</b>	<b>6,97</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>					
18.812.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	1.164.003	0,86
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>				<b>1.164.003</b>	<b>0,86</b>
<b>Japanischer Yen</b>					
403.000.000	Japan Government Five Year Bond*	0,01 %	20.09.2026	3.040.966	2,25
42.750.000	Japan Government Forty Year Bond*	0,40 %	20.03.2056	223.291	0,17
241.650.000	Japan Government Thirty Year Bond*	0,70 %	20.12.2048	1.513.052	1,12
64.950.000	Japan Government Twenty Year Bond*	0,40 %	20.03.2039	438.672	0,33
112.350.000	Japan Government Twenty Year Bond*	0,50 %	20.09.2041	743.382	0,55
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>				<b>5.959.363</b>	<b>4,42</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
60.445.000	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	2.872.675	2,13
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>2.872.675</b>	<b>2,13</b>
<b>Neuseeländischer Dollar</b>					
1.373.000	New Zealand Government Bond*	1,50 %	15.05.2031	689.283	0,51

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 39,81 % (31. Dezember 2021: 45,56 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Neuseeländischer Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.486.000	New Zealand Government Bond*	4,25 %	15.05.2034	915.632	0,68
<b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>				<b>1.604.915</b>	<b>1,19</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
276.000	United Kingdom Gilt*	0,38 %	22.10.2026	294.016	0,22
1.140.000	United Kingdom Gilt*	0,63 %	22.10.2050	611.712	0,46
112.000	United Kingdom Gilt*	1,25 %	22.10.2041	85.500	0,06
73.000	United Kingdom Gilt*	1,75 %	07.09.2037	66.161	0,05
1.336.983	United Kingdom Inflation-Linked Gilt*	1,25 %	22.11.2032	1.783.074	1,32
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>2.840.463</b>	<b>2,11</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>					
4.557.750.000	Korea Treasury Bond*	2,13 %	10.06.2027	3.357.571	2,49
2.316.680.000	Korea Treasury Bond*	2,38 %	10.12.2031	1.637.307	1,22
1.011.460.000	Korea Treasury Bond*	2,50 %	10.03.2052	635.134	0,47
<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>				<b>5.630.012</b>	<b>4,18</b>
<b>US-Dollar</b>					
250.000	Abu Dhabi Government International Bond*	1,70 %	02.03.2031	207.164	0,15
300.000	Bermuda Government International Bond*	5,00 %	15.07.2032	298.549	0,22
290.000	Development Bank of Japan Inc*	1,00 %	27.08.2030	224.395	0,17
500.000	Development Bank of Japan Inc*	1,25 %	28.01.2031	390.986	0,29
300.000	Indonesia Government International Bond*	3,55 %	31.03.2032	271.461	0,20
455.000	International Bank for Reconstruction & Development*	2,50 %	29.03.2032	399.855	0,30
140.000	International Bank for Reconstruction & Development*	3,63 %	21.09.2029	135.598	0,10
300.000	Japan International Cooperation Agency*	3,25 %	25.05.2027	284.605	0,21
375.000	Mexico Government International Bond*	4,75 %	27.04.2032	352.206	0,26
250.000	Philippine Government International Bond*	5,61 %	13.04.2033	265.099	0,20
100.000	Romanian Government International Bond*	3,00 %	14.02.2031	79.146	0,06
400.000	Saudi Government International Bond*	2,25 %	02.02.2033	326.387	0,24
2.054.000	United States Treasury Note/Bond*	0,50 %	31.03.2025	1.886.872	1,40
863.800	United States Treasury Note/Bond*	0,63 %	15.10.2024	806.809	0,60
3.161.300	United States Treasury Note/Bond*	0,88 %	31.01.2024	3.034.725	2,25
202.000	United States Treasury Note/Bond*	1,25 %	30.11.2026	181.287	0,13
40.000	United States Treasury Note/Bond*	2,38 %	31.03.2029	36.377	0,03
170.000	United States Treasury Note/Bond*	2,38 %	15.02.2042	129.881	0,10
880.000	United States Treasury Note/Bond*	2,38 %	15.05.2051	631.658	0,47
465.000	United States Treasury Note/Bond*	2,75 %	15.08.2032	423.513	0,31
1.149.000	United States Treasury Note/Bond*	2,88 %	15.05.2032	1.059.234	0,78
920.000	United States Treasury Note/Bond*	2,88 %	15.05.2052	737.437	0,55
70.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00 %	15.08.2052	57.695	0,04



## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 39,81 % (31. Dezember 2021: 45,56 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
36.000	United States Treasury Note/Bond*	3,25 %	30.06.2027	34.822	0,03
787.000	United States Treasury Note/Bond*	3,88 %	15.08.2040	768.355	0,57
820.000	United States Treasury Note/Bond*	4,13 %	15.11.2032	836.977	0,62
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>13.861.093</b>	<b>10,28</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>53.670.009</b>	<b>39,81</b>
<b>Mortgage-Backed Securities 14,14 % (31. Dezember 2021: 10,11 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
345.522	Fannie Mae Pool	2,00 %	01.02.2051	283.998	0,21
149.993	Fannie Mae Pool	2,00 %	01.04.2051	122.649	0,09
79.527	Fannie Mae Pool	2,00 %	01.05.2051	64.988	0,05
247.624	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.08.2050	212.552	0,16
129.631	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.09.2050	110.556	0,08
614.544	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.01.2051	528.457	0,39
714.401	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.05.2051	607.578	0,45
771.002	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.06.2051	654.024	0,48
456.422	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.08.2051	388.050	0,29
219.902	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.09.2051	186.946	0,14
215.389	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.04.2052	182.895	0,14
157.821	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.12.2047	141.383	0,10
159.895	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.11.2048	142.430	0,11
165.708	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.02.2049	149.436	0,11
148.519	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.03.2050	131.495	0,10
149.046	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2050	132.311	0,10
163.226	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2051	143.650	0,11
46.034	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.05.2051	40.445	0,03
56.236	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.07.2051	49.473	0,04
52.262	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.12.2041	48.969	0,04
28.005	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.04.2042	26.241	0,02
31.951	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2042	29.938	0,02
46.971	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.01.2043	43.989	0,03
70.126	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.12.2044	65.462	0,05
54.575	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.03.2045	50.867	0,04
82.913	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.12.2045	77.535	0,06
74.513	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2046	69.249	0,05
25.235	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.06.2047	23.429	0,02
147.904	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.02.2048	137.179	0,10
101.270	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.08.2051	92.326	0,07
484.259	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2052	440.547	0,33
172.108	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.08.2052	156.571	0,12

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Mortgage-Backed Securities 14,14 % (31. Dezember 2021: 10,11 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
24.845	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.12.2040	23.883	0,02
86.079	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.12.2041	83.354	0,06
11.835	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.10.2043	11.357	0,01
245.096	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.09.2044	236.455	0,18
36.222	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.01.2045	34.729	0,03
61.249	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.02.2045	58.724	0,04
154.074	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.02.2046	147.962	0,11
34.914	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2046	33.468	0,02
34.338	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.03.2047	32.816	0,02
41.847	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.05.2047	40.018	0,03
51.093	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.06.2047	48.852	0,04
24.491	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.10.2047	23.398	0,02
28.786	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.04.2048	27.479	0,02
137.193	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.03.2049	130.774	0,10
446.185	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.06.2052	418.957	0,31
97.091	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2052	91.196	0,07
13.611	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.03.2036	13.232	0,01
69.417	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.04.2041	68.881	0,05
13.427	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.09.2043	13.213	0,01
11.530	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.12.2043	11.314	0,01
22.686	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.05.2044	22.098	0,02
7.323	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.03.2047	7.199	0,01
79.256	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.07.2047	77.989	0,06
408.095	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.06.2052	393.228	0,29
168.923	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.07.2052	162.770	0,12
285.034	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.08.2052	274.628	0,20
3.185	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.10.2023	3.170	0,00
11.535	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.07.2035	11.749	0,01
20.589	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.06.2038	20.964	0,02
30.698	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.07.2039	31.322	0,02
27.768	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.09.2040	28.145	0,02
31.816	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.02.2041	32.248	0,02
28.842	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2044	29.234	0,02
8.394	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.03.2044	8.402	0,01
6.099	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.06.2048	6.077	0,00
47.248	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.09.2048	47.507	0,04
290.513	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	286.768	0,21
268.939	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	265.472	0,20
640.000	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2053	630.742	0,47
422.908	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.12.2052	424.440	0,31

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Mortgage-Backed Securities 14,14 % (31. Dezember 2021: 10,11 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.145.000	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.01.2053	1.148.182	0,85
125.000	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.01.2053	126.884	0,09
26.084	Fannie Mae Pool (AJ7686)	4,00 %	01.12.2041	25.073	0,02
23.295	Fannie Mae Pool (AL6432)	4,00 %	01.01.2045	22.335	0,02
57.989	Fannie Mae Pool (AS0657)	4,00 %	01.10.2043	55.598	0,04
19.229	Fannie Mae Pool (AS7558)	4,00 %	01.07.2046	18.408	0,01
17.955	Fannie Mae Pool (BH2877)	4,00 %	01.05.2047	17.230	0,01
299.916	Fannie Mae Pool (CB4133)	4,50 %	01.07.2052	289.245	0,21
285.307	Fannie Mae Pool (CB4211)	4,50 %	01.07.2052	274.892	0,20
134.216	Fannie Mae Pool (FS2485)	4,00 %	01.07.2052	126.623	0,09
437.136	Fannie Mae Pool (MA4325)	2,00 %	01.05.2051	357.372	0,26
24.787	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.10.2042	23.247	0,02
27.311	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.05.2043	25.590	0,02
17.046	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.06.2043	15.970	0,01
13.173	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.04.2045	12.280	0,01
61.236	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.08.2045	57.099	0,04
13.297	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.12.2045	12.382	0,01
13.404	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.04.2046	12.477	0,01
126.263	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.04.2047	117.381	0,09
53.095	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.07.2047	49.521	0,04
18.658	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.09.2047	17.328	0,01
25.187	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.10.2047	23.387	0,02
138.047	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.12.2047	128.164	0,09
41.960	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.02.2041	40.380	0,03
30.128	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.11.2041	28.994	0,02
17.345	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.11.2044	16.649	0,01
13.046	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.03.2046	12.523	0,01
102.973	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.04.2046	98.839	0,07
15.740	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.09.2046	15.095	0,01
186.531	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.12.2046	179.024	0,13
80.720	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.01.2047	77.345	0,06
95.086	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.04.2047	90.944	0,07
15.389	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.05.2047	14.733	0,01
42.873	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.08.2039	42.584	0,03
12.617	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.12.2039	12.534	0,01
4.208	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.03.2041	4.180	0,00
37.536	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.11.2043	36.979	0,03
6.509	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.10.2046	6.407	0,00
45.123	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.09.2048	44.203	0,03
8.578	Freddie Mac Gold Pool	5,00 %	01.10.2035	8.778	0,01

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Mortgage-Backed Securities 14,14 % (31. Dezember 2021: 10,11 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
20.278	Freddie Mac Gold Pool	5,00 %	01.09.2038	20.714	0,02
16.736	Freddie Mac Gold Pool	5,00 %	01.03.2047	16.756	0,01
10.809	Freddie Mac Gold Pool (Q18306)	3,50 %	01.05.2043	10.129	0,01
201.764	Freddie Mac Pool	2,00 %	01.07.2051	164.843	0,12
120.326	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.08.2051	102.296	0,08
80.490	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.02.2050	71.528	0,05
45.348	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.03.2048	42.053	0,03
465.269	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.06.2052	423.267	0,31
576.542	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.06.2052	524.849	0,39
48.232	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.05.2052	45.289	0,03
63.646	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.07.2052	59.776	0,04
218.728	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.08.2052	205.380	0,15
296.863	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.10.2052	279.205	0,21
144.767	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.07.2052	139.494	0,10
238.238	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.08.2052	229.540	0,17
192.687	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.08.2052	190.203	0,14
256.288	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.11.2052	257.290	0,19
273.771	Freddie Mac Pool (SD1818)	4,00 %	01.10.2052	257.149	0,19
140.000	Ginnie Mae	5,00 %	01.01.2053	138.746	0,10
175.000	Ginnie Mae	5,50 %	01.01.2053	176.033	0,13
234.948	Ginnie Mae II Pool	2,00 %	20.04.2051	198.218	0,15
120.173	Ginnie Mae II Pool	2,50 %	20.03.2051	104.743	0,08
460.064	Ginnie Mae II Pool	2,50 %	20.04.2051	401.194	0,30
209.643	Ginnie Mae II Pool	3,00 %	20.07.2052	186.923	0,14
551.029	Ginnie Mae II Pool	3,50 %	20.07.2052	506.831	0,38
307.912	Ginnie Mae II Pool	4,00 %	20.09.2052	291.679	0,22
496.476	Ginnie Mae II Pool	4,50 %	20.09.2052	482.162	0,36
<b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>				<b>19.062.981</b>	<b>14,14</b>
<b>Kommunalanleihen 1,27 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
115.000	City of New York NY	5,00 %	01.08.2032	135.788	0,10
150.000	City of New York NY	5,00 %	01.05.2035	170.130	0,13
25.000	Gilbert Water Resource Municipal Property Corp	5,00 %	15.07.2031	29.416	0,02
205.000	Massachusetts Development Finance Agency	5,00 %	15.11.2032	246.720	0,18
100.000	New York City Municipal Water Finance Authority	5,00 %	15.06.2031	118.116	0,09
930.000	Texas Water Development Board	5,00 %	15.10.2047	1.006.636	0,75
<b>Kommunalanleihen insgesamt †</b>				<b>1.706.806</b>	<b>1,27</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>130.875.701</b>	<b>97,08</b>

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,96 % (31. Dezember 2021: 0,61 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.271.395 AUD	811.139 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	4	51.577	0,04
640.182 AUD	416.972 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	17.428	0,01
3.102.517 AUD	1.999.216 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	106.023	0,08
441.023 AUD	295.838 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	3.422	0,00
651.861 AUD	440.837 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	1.488	0,00
1.103.066 BRL	205.298 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	3.010	0,00
306.347 CAD	222.393 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	3.718	0,00
299.492 CAD	219.232 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.819	0,00
1.694.920 CHF	1.721.988 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	4	112.883	0,08
502.628 CHF	539.021 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	5.110	0,00
203.018 CHF	219.375 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	407	0,00
100.803.625 CLP	101.693 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	16.461	0,01
36.072.491 CNY	5.060.582 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	2	163.872	0,12
8.756.463 CNY	1.231.275 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	36.941	0,03
47.163.156 CNY	6.618.778 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	211.960	0,16
4.171.499 CZK	165.774 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	18.385	0,01
7.758.940 CZK	336.451 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	6.082	0,01
2.070.479 DKK	275.229 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	22.256	0,02
1.005.812 €	1.034.170 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	5	40.368	0,03
383.855 €	394.091 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	15.992	0,01
1.543.004 €	1.627.929 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	2	20.507	0,02
572.610 €	500.000 £	18.01.2023	Société Générale	1	10.047	0,01
3.511.719 €	3.622.257 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	7	129.415	0,10
398.955 €	350.000 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	5.034	0,00
728.727 €	736.867 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	41.654	0,03
811.386 €	833.746 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	33.082	0,03
593.954 €	599.911 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	34.628	0,03
200.000 £	221.760 US\$	18.01.2023	Société Générale	1	18.915	0,02
1.225.432 £	1.390.740 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	4	83.916	0,06
104.764 £	120.623 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	5.448	0,01
100.000 HKD	12.759 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	58	0,00
39.491.646 HUF	89.071 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	15.703	0,01
1.109.930.664 IDR	70.446 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	1.431	0,00
69.731.439 ¥	497.867 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	3	31.646	0,02
9.933.608 ¥	73.104 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2.328	0,00
1.466.731.561 ¥	10.253.671 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	6	884.099	0,66
45.857.794 ¥	330.083 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	18.142	0,01
62.124.663 ¥	432.228 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	39.521	0,03
93.015.648 KRW	64.547 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	9.387	0,01
110.036.018 KRW	86.944 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	519	0,00
23.856.000 KRW	17.506 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	1.456	0,00

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 1,96 % (31. Dezember 2021: 0,61 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
17.695.034 MXN	869.982 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	35.577	0,03
3.147.437 MXN	157.642 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	3.431	0,00
2.373.000 MXN	118.904 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	2.536	0,00
2.047.065 MYR	439.803 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	28.442	0,02
1.908.598 NOK	179.114 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	2	14.751	0,01
1.494.213 NOK	147.160 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	4.613	0,00
220.841 NZD	128.576 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	11.124	0,01
574.835 NZD	342.172 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	21.458	0,02
343.021 NZD	198.131 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	18.858	0,01
1.470.336 NZD	832.892 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	97.216	0,07
480.580 PEN	119.637 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	6.187	0,01
1.135.489 PLN	225.449 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	33.134	0,03
2.290.801 SEK	219.781 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	265	0,00
4.282.937 SEK	393.178 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	18.225	0,01
7.538.013 SEK	684.069 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	40.005	0,03
441.754 SGD	309.625 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	19.854	0,02
13.530.200 THB	364.629 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	26.591	0,02
213.351 US\$	284.583 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	1	3.305	0,00
765.926 US\$	628.428 £	18.01.2023	BNP Paribas	3	9.691	0,01
218.975 US\$	1.157.503 BRL	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	388	0,00
62.775 US\$	220.612 ILS	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	217	0,00
210.193 US\$	2.066.928 NOK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	247	0,00
225.693 US\$	354.166 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.654	0,00
218.809 US\$	181.366 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	557	0,00
216.906 US\$	291.207 CAD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.970	0,00
218.065 US\$	342.620 NZD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	1.330	0,00
71.128 US\$	9.356.604 ¥	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	77	0,00
216.516 US\$	2.121.250 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.051	0,00
112.515 US\$	177.131 NZD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	465	0,00
70.770 US\$	1.378.007 MXN	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	249	0,00
230.885 US\$	338.711 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.050	0,00
439.121 US\$	691.765 NZD	18.01.2023	UBS AG	1	1.522	0,00
69.191 US\$	1.066.995.134 IDR	18.01.2023	UBS AG	1	94	0,00
147.941 US\$	122.095 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	1.014	0,00
898.679 ZAR	49.596 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	3.155	0,00
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
376 AUD	254 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	1	0,00
444 AUD	289 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	12	0,00
30.061 AUD	19.500 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	898	0,00
210 US\$	310 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,96 % (31. Dezember 2021: 0,61 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
128 €	134 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	3	0,00
28.215 ¥	204 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	10	0,00
138 US\$	2.125.094 IDR	18.01.2023	BNP Paribas	1	0	0,00
51 US\$	42 E	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	1	0,00
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
208 US\$	3.527 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	1	0,00
328.333 ZAR	18.278 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	994	0,00
8.875 ZAR	502 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	19	0,00
27.493 ZAR	1.566 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	48	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>2.638.428</b>	<b>1,96</b>

### Futures-Kontrakte 0,20 % (31. Dezember 2021: 0,02 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(18)	Canadian 10-Year Bond Future March 2023	31.883	0,02
(16)	Canadian 5-Year Bond Future March 2023	9.683	0,01
(27)	Euro-OAT Future March 2023	79.318	0,06
(24)	Short-Term Euro-BTP Future March 2023	44.825	0,03
(11)	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	69.860	0,05
(12)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	5.363	0,01
(73)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2023	12.547	0,01
21	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	16.778	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>			<b>270.257</b>

### Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens	
CNY	20.990.000	30.11.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,82 %	7D CNRR	705	0,00
CNY	33.960.000	28.11.2025	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,60 %	7D CNRR	528	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>1.233</b>	<b>0,00</b>	

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>133.785.619</b>	<b>99,24</b>

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (1,42 %) (31. Dezember 2021: (0,43 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
931.608 BRL	177.904 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(1.975)	(0,00)
275.640 CAD	206.883 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(3.437)	(0,00)
856.776 CAD	637.521 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(5.147)	(0,01)
584.244 CAD	431.553 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(331)	(0,00)
270.609 CAD	203.798 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(4.065)	(0,00)
127.189 CAD	94.874 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(998)	(0,00)
202.236 CHF	219.588 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(653)	(0,00)
562.437.353 COP	119.265 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(3.588)	(0,00)
3.104.585 €	4.500.000 CAD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(4.668)	(0,00)
206.656 €	221.943 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(1.166)	(0,00)
170.760 £	205.780 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(292)	(0,00)
78.671 £	95.602 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(931)	(0,00)
9.489.062.003 IDR	618.462 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(3.963)	(0,00)
789.360 ILS	225.925 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(2.092)	(0,00)
4.602.834 SEK	448.382 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(6.251)	(0,01)
678.284 US\$	98.184.053 ¥	18.01.2023	BNP Paribas	3	(67.287)	(0,05)
200.360 US\$	317.260 AUD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(14.920)	(0,01)
835.853 US\$	831.624 €	18.01.2023	BNP Paribas	4	(52.595)	(0,04)
162.000 US\$	3.191.407 MXN	18.01.2023	BNP Paribas	1	(1.323)	(0,00)
302.417 US\$	512.635 NZD	18.01.2023	BNP Paribas	2	(21.867)	(0,02)
301.458 US\$	410.992 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	2	(1.890)	(0,00)
218.717 US\$	195.014 £	18.01.2023	BNP Paribas	1	(15.959)	(0,01)
630.778 US\$	608.265 CHF	18.01.2023	BNP Paribas	3	(27.711)	(0,02)
64.869 US\$	91.764.184 KRW	18.01.2023	BNP Paribas	1	(8.071)	(0,01)
222.322 US\$	220.961 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(16.884)	(0,01)
755.881 US\$	5.261.956 CNY	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(5.549)	(0,01)
223.148 US\$	29.403.085 ¥	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(127)	(0,00)
484.116 US\$	817.590 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(33.077)	(0,03)
516.665 US\$	467.223 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(45.580)	(0,03)
3.484.573 US\$	4.897.950.434 KRW	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(408.605)	(0,30)
417.944 US\$	408.286 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(18.240)	(0,01)
752.301 US\$	14.891.575 MXN	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(9.788)	(0,01)
216.679 US\$	2.272.254 SEK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(1.585)	(0,00)
87.905 US\$	83.579.572 CLP	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(10.060)	(0,01)
492.443 US\$	12.391.764 CZK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(54.614)	(0,04)
131.434 US\$	118.092 £	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(10.675)	(0,01)
508.794 US\$	72.942.872 ¥	18.01.2023	Royal Bank of Canada	2	(45.105)	(0,03)
1.970.746 US\$	1.771.992 £	18.01.2023	Société Générale	2	(161.628)	(0,12)
1.023.011 US\$	7.331.401 CNY	18.01.2023	Standard Chartered Bank	3	(38.810)	(0,03)
708.494 US\$	1.099.489 AUD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(37.573)	(0,03)
1.081 US\$	22.267 TRY	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(95)	(0,00)



## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,42 %) (31. Dezember 2021: (0,43 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
125.461 US\$	172.971 CAD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(2.207)	(0,00)
34.129 US\$	55.000 NZD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(663)	(0,00)
325.201 US\$	2.266.185 CNY	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(2.727)	(0,00)
715.473 US\$	672.627 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	3	(3.115)	(0,00)
77.329 US\$	11.260.721 ¥	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(8.180)	(0,01)
335.078 US\$	300.000 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(25.935)	(0,02)
1.627.582 US\$	1.546.835 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	6	(24.947)	(0,02)
281.529 US\$	424.459 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(6.491)	(0,01)
139.936 US\$	19.025.465 ¥	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(4.536)	(0,00)
287.258 US\$	2.994.304 SEK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(365)	(0,00)
203.925 US\$	2.184.731 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(17.987)	(0,01)
574.855 US\$	9.026.597.261 IDR	18.01.2023	UBS AG	1	(9.695)	(0,01)
6.250.435 US\$	8.636.014 CAD	18.01.2023	UBS AG	2	(123.684)	(0,09)
65.824 US\$	348.856 BRL	18.01.2023	UBS AG	1	(56)	(0,00)
236.128 US\$	322.416.086 KRW	18.01.2023	UBS AG	3	(20.147)	(0,02)
1.230.220 US\$	2.171.611 NZD	18.01.2023	UBS AG	1	(143.503)	(0,11)
190.988 US\$	2.049.049 NOK	18.01.2023	UBS AG	1	(17.143)	(0,01)
594.873 US\$	4.204.998 CNY	18.01.2023	UBS AG	6	(14.146)	(0,01)
2.626.944 US\$	2.602.849 €	18.01.2023	UBS AG	5	(153.756)	(0,12)
234.166 US\$	31.277.027 ¥	18.01.2023	UBS AG	1	(3.340)	(0,00)
1.060.501 US\$	21.340.000 MXN	18.01.2023	UBS AG	1	(31.592)	(0,02)
218.376 US\$	203.837 CHF	18.01.2023	UBS AG	1	(2.292)	(0,00)
84.209 US\$	115.615 CAD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(1.124)	(0,00)
64.225 US\$	1.636.499 CZK	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(8.021)	(0,01)
66.108 US\$	1.334.596 MXN	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(2.191)	(0,00)
1.619.313 US\$	1.629.214 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(121.224)	(0,09)
73.375 US\$	10.818.602 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(8.777)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
405 AUD	276 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(1)	(0,00)
155 AUD	106 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
243 US\$	380 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(15)	(0,00)
173 US\$	267 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(8)	(0,00)
791 US\$	1.224 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(39)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
63 CAD	47 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
84 US\$	3.181 THB	18.01.2023	BNP Paribas	1	(8)	(0,00)
61 US\$	88 SGD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(4)	(0,00)
857 US\$	1.182 CAD	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(16)	(0,00)
1.087 US\$	989 £	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(103)	(0,00)
145 US\$	143 CHF	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(9)	(0,00)
114 US\$	1.286 SEK	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(9)	(0,00)

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,42 %) (31. Dezember 2021: (0,43 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen USD (Fortsetzung)</i>						
58 US\$	442 DKK	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(5)	(0,00)
44 US\$	79 NZD	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(6)	(0,00)
311 US\$	442.400 KRW	18.01.2023	UBS AG	1	(40)	(0,00)
2.622 US\$	18.655 CNY	18.01.2023	UBS AG	1	(80)	(0,00)
400 US\$	637 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(32)	(0,00)
3.645 US\$	526.179 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(351)	(0,00)
6.112 US\$	6.245 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(560)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
314 US\$	5.703 ZAR	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(20)	(0,00)
112 US\$	2.044 ZAR	18.01.2023	UBS AG	1	(8)	(0,00)
842 US\$	15.050 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(42)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(1.908.377)</b>	<b>(1,42)</b>

### Futures-Kontrakte (0,14 %) (31. Dezember 2021: (0,22 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
16	Australian Government Bond 10-Year Future March 2023	(70.201)	(0,05)
23	Canadian 2-Year Bond Future March 2023	(7.167)	(0,01)
23	Euro-BOBL Future March 2023	(33.874)	(0,03)
10	Euro-Bund Future March 2023	(30.011)	(0,02)
35	Euro-Schatz Future March 2023	(42.957)	(0,03)
12	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(5.428)	(0,00)
19	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	(1.592)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>(191.230)</b>	<b>(0,14)</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
EUR 2.785.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on iTraxx Europe S38	(13.185)	(0,01)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b>				<b>(13.185)</b>	<b>(0,01)</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(2.112.792)	(1,57)
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	131.672.827	97,67
Sonstiges Nettovermögen	3.138.469	2,33
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	134.811.296	100,00

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	76.433.632	54,37
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	51.313.968	36,50
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	3.128.101	2,23
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	79.027	0,06
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	718.099	0,51
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>131.672.827</b>	<b>93,67</b>

## Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 93,73 % (31. Dezember 2021: 88,53 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
1.000.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,95 %	31.07.2024	998.850	0,62
2.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*	3,38 %	24.07.2024	1.896.430	1,18
2.944.000	Africa Finance Corp*	3,88 %	13.04.2024	2.873.715	1,79
1.444.000	African Export-Import Bank*	4,13 %	20.06.2024	1.412.539	0,88
1.583.000	African Export-Import Bank*	5,25 %	11.10.2023	1.577.246	0,98
1.000.000	Air Lease Corp*	4,25 %	01.02.2024	983.195	0,61
1.100.000	Anglo American Capital Plc*	3,63 %	11.09.2024	1.065.042	0,66
1.500.000	Ares Capital Corp**	4,20 %	10.06.2024	1.448.864	0,90
4.100.000	Athene Global Funding**	2,75 %	25.06.2024	3.902.019	2,43
3.120.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	5,25 %	15.05.2024	3.059.587	1,91
500.000	Azure Orbit IV International Finance Ltd*	3,75 %	25.01.2023	499.370	0,31
3.389.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	3,75 %	11.04.2024	3.319.954	2,07
3.250.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT*	3,95 %	28.03.2024	3.186.452	1,99
4.000.000	Barclays Plc*	4,38 %	11.09.2024	3.909.824	2,44
435.000	Bharti Airtel International Netherlands BV*	5,35 %	20.05.2024	432.851	0,27
2.500.000	Black Sea Trade & Development Bank*	3,50 %	25.06.2024	2.265.107	1,41
3.000.000	BOC Aviation Ltd*	4,00 %	25.01.2024	2.949.694	1,84
620.000	Buckeye Partners LP**	4,15 %	01.07.2023	610.090	0,38
3.005.000	Buckeye Partners LP**	4,35 %	15.10.2024	2.907.784	1,81
1.800.000	CBQ Finance Ltd*	5,00 %	24.05.2023	1.796.126	1,12
240.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	1,75 %	10.08.2023	234.981	0,15
750.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	699.375	0,44
575.000	DCP Midstream Operating LP*	3,88 %	15.03.2023	572.671	0,36
889.000	Dianjian International Finance Ltd*	4,60 %	29.12.2049	887.667	0,55
4.139.000	DIB Sukuk Ltd*	3,63 %	06.02.2023	4.131.930	2,58
2.000.000	DP World Crescent Ltd*	3,91 %	31.05.2023	1.986.438	1,24
1.333.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88 %	23.05.2024	1.286.678	0,80
3.685.000	EQM Midstream Partners LP*	4,00 %	01.08.2024	3.547.513	2,21
3.000.000	ERAC USA Finance LLC**	2,70 %	01.11.2023	2.938.435	1,83
1.745.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	5,13 %	15.05.2024	1.718.026	1,07
1.000.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,37 %	17.11.2023	976.771	0,61
1.040.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,81 %	09.01.2024	1.012.973	0,63
2.895.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,58 %	18.03.2024	2.863.300	1,79
4.550.000	General Motors Financial Co Inc*	3,95 %	13.04.2024	4.462.623	2,78
1.155.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	5,63 %	15.06.2024	1.116.960	0,70
944.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	5,13 %	15.05.2024	937.055	0,58
1.185.000	Hanesbrands Inc**	4,63 %	15.05.2024	1.149.637	0,72
1.750.000	HSBC Holdings Plc*	4,25 %	14.03.2024	1.719.758	1,07
1.800.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,25 %	13.11.2024	1.662.445	1,04
700.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75 %	29.05.2024	665.597	0,42

## Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 93,73 % (31. Dezember 2021: 88,53 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.500.000	Hyundai Capital America**	3,40 %	20.06.2024	2.414.029	1,51
1.930.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88 %	01.11.2024	1.871.703	1,17
1.500.000	Marriott International Inc**	3,60 %	15.04.2024	1.470.716	0,92
3.800.000	Mashreqbank PSC*	4,25 %	26.02.2024	3.738.087	2,33
1.650.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	5,50 %	15.04.2024	1.607.772	1,00
889.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38 %	29.12.2049	855.663	0,53
563.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	4,76 %	11.11.2024	549.520	0,34
4.600.000	NatWest Group Plc*	5,13 %	28.05.2024	4.557.405	2,84
3.025.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88 %	01.06.2024	2.933.618	1,83
4.000.000	NRG Energy Inc**	3,75 %	15.06.2024	3.854.761	2,40
3.570.000	OneMain Finance Corp**	6,13 %	15.03.2024	3.461.115	2,16
3.580.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,25 %	15.04.2024	3.522.827	2,20
1.500.000	QIB Sukuk Ltd*	3,98 %	26.03.2024	1.475.468	0,92
1.000.000	QIIB Senior Sukuk Ltd*	4,26 %	05.03.2024	986.717	0,62
2.500.000	Rakfunding Cayman Ltd*	4,13 %	09.04.2024	2.459.668	1,53
1.250.000	REC Ltd*	3,38 %	25.07.2024	1.199.569	0,75
1.250.000	REC Ltd*	3,50 %	12.12.2024	1.197.637	0,75
989.000	REC Ltd*	5,25 %	13.11.2023	983.756	0,61
1.889.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,22 %	27.01.2024	1.872.377	1,17
1.165.000	Service Properties Trust**	4,65 %	15.03.2024	1.114.558	0,69
1.000.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	963.170	0,60
1.950.000	Six Flags Entertainment Corp**	4,88 %	31.07.2024	1.880.531	1,17
2.500.000	SNB Funding Ltd*	2,75 %	02.10.2024	2.393.399	1,49
2.600.000	Societe Generale SA**	2,63 %	16.10.2024	2.462.126	1,54
1.670.000	Sprint LLC**	7,13 %	15.06.2024	1.706.306	1,06
1.550.000	Starwood Property Trust Inc**	5,50 %	01.11.2023	1.538.855	0,96
2.000.000	Sunny Optical Technology Group Co Ltd*	3,75 %	23.01.2023	1.997.925	1,25
3.850.000	Synchrony Financial*	4,25 %	15.08.2024	3.763.997	2,35
2.140.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc**	5,63 %	01.03.2024	2.133.901	1,33
2.780.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*	5,88 %	15.06.2024	2.770.784	1,73
2.600.000	Ventas Realty LP*	3,50 %	15.04.2024	2.530.309	1,58
4.000.000	Warnermedia Holdings Inc**	3,53 %	15.03.2024	3.878.327	2,42
1.000.000	Weibo Corp*	3,50 %	05.07.2024	969.263	0,60
2.750.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	4,25 %	30.05.2023	2.714.563	1,69
889.000	Wynn Macau Ltd*	4,88 %	01.10.2024	840.743	0,52
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>150.336.737</b>	<b>93,73</b>
<b>Staatsanleihen 2,45 % (31. Dezember 2021: 4,70 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
400.000	Egypt Government International Bond	4,55 %	20.11.2023	387.833	0,24

## Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 2,45 % (31. Dezember 2021: 4,70 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.289.000	Egypt Government International Bond	6,20 %	01.03.2024	2.216.869	1,38
889.000	Oman Government International Bond	4,13 %	17.01.2023	888.219	0,56
444.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,67 %	17.01.2024	438.215	0,27
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>3.931.136</b>	<b>2,45</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>154.267.873</b>	<b>96,18</b>

Devisenterminkontrakte 0,33 % (31. Dezember 2021: 0,01 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
2.297.044 €	2.290.735 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	163.266	0,10
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
10.436 £	12.524 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	34	0,00
1.958.228 £	2.208.105 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	148.381	0,10
11.991 US\$	9.944 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	24	0,00
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
6.718.461 HKD	857.216 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	3.888	0,00
66.649 HKD	8.503 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	39	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
4.845.513 SGD	3.405.630 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	208.355	0,13
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>523.987</b>	<b>0,33</b>
					<b>Zeitwert % des Netto- US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>154.791.860</b>	<b>96,51</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2021: (0,03 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
10.107 £	12.566 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(404)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
41.262 HKD	5.302 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(13)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(417)</b>	<b>(0,00)</b>

## Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(417)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>154.791.443</b>	<b>96,51</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>5.604.643</b>	<b>3,49</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>160.396.086</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	97.268.348	47,08
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	56.999.525	27,59
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	523.570	0,25
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>154.791.443</b>	<b>74,92</b>

## Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 100,15 % (31. Dezember 2021: 98,56 %)</b>			
<b>Kanadischer Dollar</b>			
363.167	Element Fleet Management Corp	4.945.150	6,23
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>		<b>4.945.150</b>	<b>6,23</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
1.312.430	Pets at Home Group Plc	4.451.857	5,61
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>4.451.857</b>	<b>5,61</b>
<b>US-Dollar</b>			
54.761	Alibaba Group Holding Ltd ADR	4.823.897	6,08
36.757	Alphabet Inc Class A	3.243.070	4,09
40.455	Amdocs Ltd	3.677.360	4,64
8.104	Aon Plc Class A	2.432.335	3,07
103.849	ATI Inc	3.100.931	3,91
113.477	Corning Inc	3.624.455	4,57
171.930	Criteo SA ADR	4.480.496	5,65
117.099	Delta Air Lines Inc	3.847.873	4,85
428.731	Despegar.com Corp	2.199.390	2,77
43.064	Expedia Group Inc	3.772.406	4,75
145.679	Gen Digital Inc	3.121.901	3,93
38.918	ModivCare Inc	3.492.112	4,40
2.942	Nice Ltd ADR	565.747	0,71
595.589	Paya Holdings Inc	4.687.285	5,91
120.345	Perrigo Co Plc	4.102.561	5,17
16.228	Quanta Services Inc	2.312.490	2,91
98.046	Scholastic Corp	3.868.895	4,88
78.584	Stericycle Inc	3.920.556	4,94
21.992	TE Connectivity Ltd	2.524.682	3,18
9.776	Tetra Tech Inc	1.419.377	1,79
140.645	Vistra Corp	3.262.964	4,11
194.314	Zeta Global Holdings Corp Class A	1.587.545	2,00
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>70.068.328</b>	<b>88,31</b>
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>79.465.335</b>	<b>100,15</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>79.465.335</b>	<b>100,15</b>
		<b>Zeitwert % des Netto- US\$ vermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>79.465.335</b>	<b>100,15</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>		<b>79.465.335</b>	<b>100,15</b>
<b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>		<b>(120.970)</b>	<b>(0,15)</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>79.344.365</b>	<b>100,00</b>



## Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	79.465.335	99,71
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>79.465.335</b>	<b>99,71</b>

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung			Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Aktien 1,33 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
5.000	McAfee LLC			5.247.334	1,33
<b>Aktien insgesamt *</b>				<b>5.247.334</b>	<b>1,33</b>
Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 6,10 % (31. Dezember 2021: 2,59 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
2.000.000	AGL CLO 19 Ltd Series 2022-19X Class E	12,66 %	21.07.2035	1.924.995	0,49
2.500.000	Aimco CDO Series 2021-16X Class D	7,69 %	17.01.2035	2.328.306	0,59
1.500.000	Annisa CLO Ltd Series 2016-2X Class DR	7,81 %	20.07.2031	1.400.719	0,36
1.000.000	Apidos CLO XL Series 2022-40X Class E	12,35 %	15.07.2035	946.789	0,24
1.000.000	Benefit Street Partners CLO XVII Ltd Series 2022-27X Class E	11,41 %	20.07.2035	965.340	0,24
1.950.000	CIFC Funding 2018-I Ltd Class D	6,84 %	18.04.2031	1.814.331	0,46
500.000	CIFC Funding 2018-II Ltd Class C	7,09 %	20.04.2031	468.882	0,12
3.000.000	Dryden 93 CLO Ltd Series 2021-93X Class D	7,74 %	15.01.2034	2.744.366	0,70
2.250.000	Invesco CLO Ltd Series 2021-3X Class D	7,82 %	22.10.2034	2.094.950	0,53
500.000	Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class C	7,41 %	20.01.2031	441.177	0,11
700.000	Oha Credit Funding 11 Ltd Series 2022-11X Class E	11,88 %	19.07.2033	642.156	0,16
1.000.000	Oha Credit Funding 12 Ltd Series 2022-12X Class E	12,40 %	20.07.2033	952.030	0,24
1.000.000	Symphony Ltd Series 2022-34X Class E	10,09 %	24.07.2034	932.817	0,24
2.000.000	TCW CLO Ltd Series 2018-1X Class D	7,27 %	25.04.2031	1.755.489	0,44
1.000.000	Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class D1R	7,86 %	25.01.2035	898.806	0,23
3.000.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class D	8,36 %	25.04.2033	2.807.611	0,71
1.000.000	Trinitas CLO XIX Ltd Series 2022-19X Class E	12,70 %	23.10.2033	960.277	0,24
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>24.079.041</b>	<b>6,10</b>
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %)</b>					
<b>Euro</b>					
1.000.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	921.534	0,23
600.000	ABN AMRO Bank NV*	4,38 %	22.09.2171	591.744	0,15
1.000.000	Accor SA*	2,63 %	30.04.2171	885.939	0,22
1.000.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	909.337	0,23
900.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	872.897	0,22
1.010.000	Altice Finco SA*	4,75 %	15.01.2028	806.421	0,20
1.250.000	Altice France Holding SA*	8,00 %	15.05.2027	988.874	0,25
600.000	Banco Santander SA*	4,13 %	12.08.2171	513.337	0,13
1.999.000	BCP V Modular Services Finance Plc**	6,75 %	30.11.2029	1.590.818	0,40
1.250.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25 %	30.04.2029	1.161.752	0,29
1.367.000	Chrome Holdco SASU*	5,00 %	31.05.2029	1.138.698	0,29
500.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	463.075	0,12

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Euro (Fortsetzung)</b>				
599.000	Cirsa Finance International Sarl*	10,38 %	30.11.2027	656.685 0,17
1.000.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38 %	15.05.2026	986.683 0,25
600.000	Commerzbank AG*	6,50 %	09.04.2171	578.955 0,15
600.000	Cooperatieve Rabobank UA*	4,38 %	29.12.2171	571.556 0,14
1.000.000	Ctec II GmbH**	5,25 %	15.02.2030	895.484 0,23
1.000.000	DKT Finance Aps**	7,00 %	17.06.2023	1.063.213 0,27
699.000	Dufry One BV**	2,00 %	15.02.2027	613.554 0,16
499.000	Dufry One BV*	3,38 %	15.04.2028	444.151 0,11
500.000	eG Global Finance Plc*	3,63 %	07.02.2024	507.683 0,13
902.000	eG Global Finance Plc*	6,25 %	30.10.2025	847.925 0,21
503.000	Emeria SASU**	3,38 %	31.03.2028	449.872 0,11
1.430.000	Fastighets AB Balder*	2,87 %	02.06.2081	1.051.858 0,27
1.050.000	Faurecia SE*	2,63 %	15.06.2025	1.023.199 0,26
447.000	Faurecia SE*	7,25 %	15.06.2026	482.359 0,12
802.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00 %	31.03.2029	662.658 0,17
729.000	Gruenthal GmbH**	4,13 %	15.05.2028	703.744 0,18
1.250.000	Guala Closures SpA*	3,25 %	15.06.2028	1.148.438 0,29
615.000	HSBC Holdings Plc*	4,75 %	04.01.2172	564.936 0,14
1.500.000	Iliad Holding SASU**	5,63 %	15.10.2028	1.460.446 0,37
1.500.000	Intrum AB*	3,00 %	15.09.2027	1.286.760 0,33
352.000	Intrum AB*	9,25 %	15.03.2028	372.569 0,09
2.102.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	1.713.651 0,43
1.000.000	Kronos International Inc**	3,75 %	15.09.2025	938.204 0,24
1.000.000	Laboratoire Eimer Selas**	5,00 %	01.02.2029	819.287 0,21
440.000	LeasePlan Corp NV*	7,38 %	29.11.2171	466.242 0,12
500.000	LHMC Finco 2 Sarl*	7,25 %	02.10.2025	463.010 0,12
1.500.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	1.440.815 0,37
750.000	Loxam SAS*	4,50 %	15.02.2027	735.658 0,19
1.160.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	1.063.490 0,27
750.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	561.890 0,14
986.000	Motion Bondco DAC*	4,50 %	15.11.2027	870.813 0,22
700.000	Motion Finco Sarl**	7,00 %	15.05.2025	747.694 0,19
1.000.000	Olympus Water US Holding Corp*	3,88 %	01.10.2028	870.591 0,22
750.000	Petroleos Mexicanos*	4,75 %	26.02.2029	628.378 0,16
1.000.000	Petroleos Mexicanos*	4,88 %	21.02.2028	875.431 0,22
1.002.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50 %	15.02.2025	938.983 0,24
750.000	Playtech Plc*	4,25 %	07.03.2026	758.836 0,19
750.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,62 %	30.04.2171	316.637 0,08
1.700.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63 %	15.03.2028	1.569.951 0,40
1.000.000	Schaeffler AG*	3,38 %	12.10.2028	934.338 0,24

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
750.000	TeamSystem SpA*	3,50 %	15.02.2028	674.076	0,17
439.599	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	442.976	0,11
1.750.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	1.722.951	0,44
750.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	3,75 %	09.05.2027	695.698	0,18
750.000	Titan Holdings II BV*	5,13 %	15.07.2029	638.175	0,16
900.000	TK Elevator Holdco GmbH**	6,63 %	15.07.2028	800.145	0,20
1.250.000	Trivium Packaging Finance BV*	3,75 %	15.08.2026	1.224.002	0,31
500.000	United Group BV*	4,00 %	15.11.2027	399.967	0,10
500.000	United Group BV**	4,88 %	01.07.2024	498.633	0,13
800.000	Verisure Holding AB*	3,25 %	15.02.2027	744.099	0,19
1.201.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	1.034.964	0,26
800.000	Vivion Investments Sarl*	3,50 %	01.11.2025	642.707	0,16
438.000	Wp/ap Telecom Holdings III BV**	5,50 %	15.01.2030	386.132	0,10
900.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	736.423	0,19
1.000.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	902.131	0,23
<b>Euro insgesamt</b>				<b>55.474.132</b>	<b>14,06</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
1.500.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	1.449.994	0,37
656.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl*	4,88 %	01.06.2028	625.710	0,16
1.000.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	833.549	0,21
1.000.000	Bellis Finco Plc**	4,00 %	16.02.2027	888.525	0,23
900.000	Castle UK Finco Plc**	7,00 %	15.05.2029	758.518	0,19
751.000	Constellation Automotive Financing Plc*	4,88 %	15.07.2027	596.952	0,15
998.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	1.107.096	0,28
1.750.000	Encore Capital Group Inc*	4,25 %	01.06.2028	1.631.307	0,41
600.000	Lloyds Banking Group Plc*	5,13 %	27.03.2171	665.917	0,17
700.000	Nationwide Building Society*	5,75 %	20.12.2171	753.214	0,19
800.000	NatWest Group Plc*	5,13 %	31.12.2171	810.449	0,21
490.000	Santander UK Group Holdings Plc*	6,75 %	24.06.2171	567.660	0,14
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>10.688.891</b>	<b>2,71</b>
<b>US-Dollar</b>					
1.675.000	AbbVie Inc*	4,25 %	21.11.2049	1.398.668	0,35
1.400.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95 %	12.02.2030	1.072.469	0,27
500.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	4,38 %	03.07.2029	421.591	0,11
3.185.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,30 %	30.01.2032	2.497.698	0,63
297.000	Agrosuper SA**	4,60 %	20.01.2032	263.648	0,07
1.170.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63 %	01.05.2028	941.903	0,24
2.245.781	Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust**	5,25 %	01.04.2029	2.125.075	0,54

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
2.000.000	Air Lease Corp*	4,63 %	01.10.2028	1.874.546 0,48
1.686.447	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	4,80 %	15.08.2027	1.608.110 0,41
482.236	Alfa Desarrollo SpA**	4,55 %	27.09.2051	367.293 0,09
1.000.000	Alfa SAB de CV**	6,88 %	25.03.2044	978.369 0,25
333.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,20 %	06.12.2047	255.672 0,06
667.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,40 %	06.12.2057	512.785 0,13
1.605.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,00 %	01.06.2029	1.166.931 0,30
1.306.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	1.297.145 0,33
2.075.000	Altice France Holding SA**	6,00 %	15.02.2028	1.229.317 0,31
402.000	America Movil SAB de CV**	5,38 %	04.04.2032	363.386 0,09
4.990.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	4.807.373 1,22
1.675.000	Amgen Inc**	4,66 %	15.06.2051	1.449.994 0,37
1.155.000	AmWINS Group Inc**	4,88 %	30.06.2029	981.111 0,25
1.579.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,60 %	15.04.2048	1.380.147 0,35
2.000.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	1.658.974 0,42
200.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63 %	07.10.2026	182.075 0,05
1.000.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	749.322 0,19
1.820.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	1.625.133 0,41
3.090.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	2.547.209 0,65
2.007.000	AT&T Inc**	3,65 %	15.09.2059	1.352.616 0,34
1.000.000	AT&T Inc*	4,50 %	09.03.2048	818.902 0,21
1.510.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38 %	01.03.2029	1.293.675 0,33
288.000	Azul Investments LLP**	7,25 %	15.06.2026	176.040 0,04
925.000	Banco Davivienda SA**	6,65 %	22.10.2171	714.563 0,18
500.000	Banco de Bogota SA*	6,25 %	12.05.2026	491.148 0,12
500.000	Banco do Brasil SA*	6,25 %	15.10.2171	449.900 0,11
979.000	Banco Mercantil del Norte SA**	6,63 %	24.01.2171	811.872 0,21
750.000	Barclays Plc*	4,38 %	15.12.2171	573.750 0,15
698.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	630.727 0,16
3.050.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	2.843.426 0,72
2.000.000	BPCE SA**	3,12 %	19.10.2032	1.463.769 0,37
892.000	Braskem Idesa SAPI**	6,99 %	20.02.2032	635.765 0,16
1.000.000	Braskem Idesa SAPI*	7,45 %	15.11.2029	791.094 0,20
3.000.000	Broadcom Inc**	3,19 %	15.11.2036	2.164.264 0,55
650.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88 %	15.04.2029	554.048 0,14
2.705.000	Buckeye Partners LP**	5,85 %	15.11.2043	2.032.722 0,52
2.105.000	Cablevision Lightpath LLC**	5,63 %	15.09.2028	1.567.651 0,40
1.605.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	1.474.875 0,37
742.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	656.496 0,17
835.000	Carnival Corp**	5,75 %	01.03.2027	597.668 0,15

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
1.065.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd**	10,38 %	01.05.2028	1.095.230 0,28
1.410.000	Cars.com Inc**	6,38 %	01.11.2028	1.254.177 0,32
626.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	12.07.2171	492.155 0,12
475.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,13 %	15.02.2029	378.812 0,10
750.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd*	4,88 %	17.08.2026	718.896 0,18
2.530.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	01.02.2031	2.035.132 0,52
2.500.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	3,28 %	01.12.2028	2.145.087 0,54
1.100.000	Cedar Fair LP**	5,25 %	15.07.2029	989.620 0,25
500.000	Cemex SAB de CV**	5,45 %	19.11.2029	481.437 0,12
1.995.000	Centene Corp*	2,50 %	01.03.2031	1.564.874 0,40
333.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	311.100 0,08
1.745.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	1.756.412 0,45
630.000	Chart Industries Inc**	9,50 %	01.01.2031	646.893 0,16
1.470.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	1.072.935 0,27
1.550.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	5,75 %	01.04.2048	1.275.340 0,32
1.685.000	Cheniere Energy Partners LP**	3,25 %	31.01.2032	1.341.356 0,34
547.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	508.334 0,13
1.430.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,13 %	01.04.2030	710.786 0,18
1.655.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,88 %	15.04.2029	853.704 0,22
827.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95 %	20.10.2025	218.632 0,06
615.000	Citigroup Inc**	4,15 %	15.02.2171	503.641 0,13
1.000.000	Citigroup Inc**	5,00 %	12.03.2171	892.512 0,23
200.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	181.677 0,05
767.000	Comision Federal de Electricidad*	4,69 %	15.05.2029	681.747 0,17
515.000	CommScope Inc**	7,13 %	01.07.2028	368.994 0,09
1.540.000	CommScope Technologies LLC**	5,00 %	15.03.2027	1.048.404 0,27
432.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	371.022 0,09
1.365.000	Condor Merger Sub Inc**	7,38 %	15.02.2030	1.099.939 0,28
2.230.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	1.952.098 0,49
1.000.000	Credit Suisse Group AG*	9,75 %	23.12.2171	873.567 0,22
2.165.000	CSC Holdings LLC**	4,63 %	01.12.2030	1.201.227 0,30
970.000	CSC Holdings LLC**	5,75 %	15.01.2030	549.209 0,14
1.100.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	872.581 0,22
555.000	CT Trust**	5,13 %	03.02.2032	488.143 0,12
2.030.000	CVS Health Corp*	5,05 %	25.03.2048	1.832.350 0,46
1.745.000	DaVita Inc**	4,63 %	01.06.2030	1.407.415 0,36
1.680.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00 %	01.02.2028	1.480.842 0,38
1.500.000	Dell International LLC/EMC Corp*	6,20 %	15.07.2030	1.528.638 0,39
750.000	Discover Financial Services**	5,50 %	30.04.2171	599.826 0,15
2.625.000	Discovery Communications LLC**	4,00 %	15.09.2055	1.586.509 0,40

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
1.675.000	Dominion Energy Inc*	4,85 %	15.08.2052	1.455.440 0,37
910.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc**	6,63 %	15.10.2029	639.554 0,16
350.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13 %	30.06.2028	290.664 0,07
735.000	Ecopetrol SA*	4,63 %	02.11.2031	562.925 0,14
750.000	Edison International**	5,00 %	15.03.2171	628.837 0,16
400.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	4,39 %	30.11.2046	308.333 0,08
600.000	Emirates NBD Bank PJSC*	4,25 %	27.11.2169	534.750 0,14
538.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,45 %	16.09.2031	454.307 0,12
300.000	Endeavour Mining Plc*	5,00 %	14.10.2026	258.390 0,07
850.000	Endurance International Group Holdings Inc**	6,00 %	15.02.2029	585.395 0,15
341.773	Energean Israel Finance Ltd*	4,88 %	30.03.2026	315.183 0,08
1.500.000	Enterprise Products Operating LLC*	4,85 %	15.03.2044	1.329.425 0,34
3.000.000	EPR Properties**	3,60 %	15.11.2031	2.179.977 0,55
1.245.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75 %	15.01.2031	1.020.221 0,26
475.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2030	458.327 0,12
1.675.000	Essential Utilities Inc*	5,30 %	01.05.2052	1.575.696 0,40
745.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	5,88 %	15.04.2030	695.065 0,18
1.195.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	6,13 %	15.04.2032	1.116.184 0,28
2.985.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,13 %	17.08.2027	2.678.426 0,68
1.000.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	796.608 0,20
1.500.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	1.508.640 0,38
403.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	325.450 0,08
2.000.000	General Motors Co*	5,00 %	01.04.2035	1.728.503 0,44
1.300.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	7,75 %	01.02.2028	1.198.678 0,30
2.040.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	1.929.473 0,49
1.619.740	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50 %	15.09.2024	1.380.261 0,35
850.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	7,50 %	15.04.2032	673.964 0,17
414.000	Gol Finance SA*	7,00 %	31.01.2025	183.886 0,05
615.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,80 %	10.11.2171	501.810 0,13
760.000	Graham Packaging Co Inc**	7,13 %	15.08.2028	635.339 0,16
1.481.874	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	1.244.518 0,31
360.586	Guara Norte Sarl**	5,20 %	15.06.2034	305.623 0,08
1.665.000	Harvest Midstream I LP**	7,50 %	01.09.2028	1.593.189 0,40
2.000.000	HCA Inc*	5,25 %	15.06.2049	1.712.826 0,43
1.114.000	HDFC Bank Ltd*	3,70 %	25.02.2171	958.597 0,24
730.000	HealthEquity Inc**	4,50 %	01.10.2029	638.859 0,16
440.000	Hess Corp*	5,60 %	15.02.2041	417.847 0,11
1.000.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,38 %	24.02.2030	763.224 0,19
500.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	4,50 %	29.05.2029	415.454 0,11
450.000	HUB International Ltd**	7,00 %	01.05.2026	441.459 0,11

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
285.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	259.224 0,07
1.995.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13 %	01.04.2029	1.809.834 0,46
305.900	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38 %	01.06.2028	292.117 0,07
750.000	ING Groep NV*	3,88 %	16.11.2171	550.214 0,14
1.005.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00 %	15.09.2028	812.513 0,21
350.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25 %	26.04.2029	335.095 0,09
2.645.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	2.296.895 0,58
1.290.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	1.088.779 0,28
1.620.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	5,88 %	15.01.2028	1.233.953 0,31
1.000.000	JPMorgan Chase & Co**	5,00 %	01.02.2171	915.556 0,23
1.000.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	793.281 0,20
500.000	KazMunayGas National Co JSC*	6,38 %	24.10.2048	413.948 0,11
1.550.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	1.508.057 0,38
2.000.000	Kinder Morgan Energy Partners LP*	5,50 %	01.03.2044	1.817.548 0,46
500.000	Klabn Austria GmbH**	3,20 %	12.01.2031	400.650 0,10
800.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	683.264 0,17
800.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40 %	25.09.2171	712.000 0,18
1.085.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	905.161 0,23
500.000	Leviathan Bond Ltd*	6,75 %	30.06.2030	473.316 0,12
585.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2029	339.942 0,09
1.000.000	Lowe's Cos Inc*	4,25 %	01.04.2052	797.798 0,20
1.000.000	M&T Bank Corp**	3,50 %	01.03.2171	777.510 0,20
500.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	387.023 0,10
260.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,25 %	15.04.2025	240.962 0,06
1.000.000	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	826.558 0,21
1.530.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	1.267.249 0,32
1.000.000	Medco Oak Tree Pte Ltd*	7,38 %	14.05.2026	953.751 0,24
1.390.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	1.122.766 0,28
1.225.000	Medline Borrower LP**	5,25 %	01.10.2029	975.167 0,25
204.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	157.511 0,04
300.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	257.772 0,07
500.000	MGM China Holdings Ltd**	4,75 %	01.02.2027	442.971 0,11
1.000.000	Millicom International Cellular SA**	4,50 %	27.04.2031	841.657 0,21
912.000	Minsur SA**	4,50 %	28.10.2031	793.618 0,20
403.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd*	3,08 %	07.04.2031	355.144 0,09
1.675.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	1.306.100 0,33
1.750.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,50 %	01.09.2028	1.368.745 0,35
885.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75 %	01.11.2028	590.483 0,15
1.500.000	MPLX LP*	5,50 %	15.02.2049	1.325.491 0,34
1.985.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	3,50 %	15.03.2031	1.364.834 0,35



## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
1.040.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp <sup>*</sup>	5,00 %	15.10.2027	876.470 0,22
860.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp <sup>*</sup>	5,25 %	01.08.2026	784.668 0,20
300.000	MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA <sup>**</sup>	6,88 %	01.02.2025	203.733 0,05
2.000.000	NatWest Group Plc <sup>*</sup>	3,03 %	28.11.2035	1.476.642 0,37
530.000	NCL Corp Ltd <sup>**</sup>	5,88 %	15.03.2026	417.216 0,11
1.860.000	New Fortress Energy Inc <sup>**</sup>	6,50 %	30.09.2026	1.730.916 0,44
800.000	Nexa Resources SA <sup>**</sup>	5,38 %	04.05.2027	750.304 0,19
570.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc <sup>**</sup>	6,00 %	15.02.2028	442.054 0,11
670.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc <sup>**</sup>	10,75 %	01.06.2028	626.755 0,16
1.950.000	NRG Energy Inc <sup>**</sup>	3,88 %	15.02.2032	1.468.301 0,37
1.930.000	Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>	4,30 %	15.08.2039	1.548.519 0,39
1.435.000	Olympus Water US Holding Corp <sup>**</sup>	6,25 %	01.10.2029	1.091.326 0,28
1.695.000	OneMain Finance Corp <sup>*</sup>	3,88 %	15.09.2028	1.350.101 0,34
355.000	OneMain Finance Corp <sup>**</sup>	6,88 %	15.03.2025	341.831 0,09
1.265.000	OneMain Finance Corp <sup>**</sup>	7,13 %	15.03.2026	1.205.684 0,31
1.185.000	Open Text Holdings Inc <sup>**</sup>	4,13 %	01.12.2031	922.807 0,23
1.000.000	Oracle Corp <sup>*</sup>	3,60 %	01.04.2050	677.450 0,17
1.630.000	Oracle Corp <sup>*</sup>	4,00 %	15.11.2047	1.198.304 0,30
272.000	Oryx Funding Ltd <sup>*</sup>	5,80 %	03.02.2031	260.402 0,07
550.000	Oztel Holdings SPC Ltd <sup>*</sup>	6,63 %	24.04.2028	553.457 0,14
1.350.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp <sup>**</sup>	8,00 %	15.11.2029	878.836 0,22
1.500.000	Performance Food Group Inc <sup>**</sup>	4,25 %	01.08.2029	1.301.700 0,33
1.925.000	Periama Holdings LLC <sup>*</sup>	5,95 %	19.04.2026	1.804.199 0,46
635.000	Petrobras Global Finance BV <sup>*</sup>	5,50 %	10.06.2051	487.722 0,12
311.000	Petrofac Ltd <sup>**</sup>	9,75 %	15.11.2026	176.157 0,04
468.000	Petroleos del Peru SA <sup>*</sup>	5,63 %	19.06.2047	306.926 0,08
1.800.000	Petroleos Mexicanos <sup>*</sup>	5,95 %	28.01.2031	1.366.439 0,35
2.500.000	Petroleos Mexicanos <sup>*</sup>	6,50 %	23.01.2029	2.145.707 0,54
471.000	Petrorio Luxembourg Trading Sarl <sup>**</sup>	6,13 %	09.06.2026	448.854 0,11
1.715.000	Pilgrim's Pride Corp <sup>**</sup>	3,50 %	01.03.2032	1.344.466 0,34
1.500.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp <sup>**</sup>	3,55 %	15.12.2029	1.303.848 0,33
900.000	Power Finance Corp Ltd <sup>*</sup>	4,50 %	18.06.2029	832.318 0,21
1.695.000	Presidio Holdings Inc <sup>**</sup>	8,25 %	01.02.2028	1.574.079 0,40
2.200.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc <sup>**</sup>	6,25 %	15.01.2028	2.006.884 0,51
500.000	Prosus NV <sup>*</sup>	3,83 %	08.02.2051	303.821 0,08
1.240.000	Rackspace Technology Global Inc <sup>**</sup>	3,50 %	15.02.2028	722.139 0,18
2.120.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp <sup>**</sup>	5,25 %	15.04.2030	1.549.317 0,39
2.020.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp <sup>**</sup>	5,75 %	15.01.2029	1.530.534 0,39
409.000	Rede D'or Finance Sarl <sup>**</sup>	4,50 %	22.01.2030	355.216 0,09
1.049.000	Reliance Industries Ltd <sup>*</sup>	3,63 %	12.01.2052	690.354 0,18

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
1.000.000	Rogers Communications Inc**	3,80 %	15.03.2032	865.664 0,22
550.000	Sands China Ltd*	5,90 %	08.08.2028	515.715 0,13
1.000.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	910.094 0,23
900.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	725.723 0,18
727.000	Service Properties Trust**	3,95 %	15.01.2028	517.313 0,13
750.000	Shelf Drilling Holdings Ltd**	8,25 %	15.02.2025	652.069 0,17
532.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	512.406 0,13
1.902.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	1.495.076 0,38
423.000	Simpar Europe SA**	5,20 %	26.01.2031	320.985 0,08
1.965.000	Sirius XM Radio Inc**	3,88 %	01.09.2031	1.536.815 0,39
690.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00 %	01.08.2027	639.327 0,16
1.150.000	Sirius XM Radio Inc**	5,50 %	01.07.2029	1.052.290 0,27
1.720.000	SPX FLOW Inc**	8,75 %	01.04.2030	1.358.731 0,34
1.000.000	SRS Distribution Inc**	6,00 %	01.12.2029	797.153 0,20
2.040.000	Standard Industries Inc**	3,38 %	15.01.2031	1.539.360 0,39
804.000	Stillwater Mining Co*	4,00 %	16.11.2026	711.014 0,18
300.000	Studio City Finance Ltd*	6,50 %	15.01.2028	233.430 0,06
900.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50 %	31.10.2026	731.421 0,19
4.035.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	8,50 %	15.10.2026	3.848.744 0,98
500.000	Suzano Austria GmbH*	5,00 %	15.01.2030	469.012 0,12
1.380.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	1.195.121 0,30
890.000	Team Health Holdings Inc**	6,38 %	01.02.2025	514.260 0,13
750.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	475.547 0,12
322.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,75 %	09.05.2027	291.458 0,07
500.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	311.255 0,08
200.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 144A*	3,75 %	18.06.2050	124.502 0,03
2.000.000	T-Mobile USA Inc*	4,50 %	15.04.2050	1.654.172 0,42
1.230.000	TMS International Corp**	6,25 %	15.04.2029	882.777 0,22
482.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	377.041 0,10
1.485.000	TransDigm Inc*	5,50 %	15.11.2027	1.397.504 0,35
435.000	TransDigm Inc*	6,38 %	15.06.2026	423.870 0,11
222.000	Transportadora de Gas del Sur SA*	6,75 %	02.05.2025	205.423 0,05
300.000	Tullow Oil Plc*	10,25 %	15.05.2026	241.146 0,06
500.000	Turk Telekomunikasyon AS*	4,88 %	19.06.2024	472.068 0,12
1.000.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75 %	01.10.2026	996.043 0,25
2.371.150	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88 %	15.10.2027	2.341.106 0,59
1.955.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50 %	15.02.2029	1.298.843 0,33
207.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*	3,98 %	09.11.2027	177.846 0,05
1.500.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	1.308.214 0,33
1.150.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	923.594 0,23

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 80,14 % (31. Dezember 2021: 82,37 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.670.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	1.508.711	0,38
1.810.000	Vistra Corp**	7,00 %	15.06.2171	1.649.595	0,42
1.675.000	Vodafone Group Plc**	5,25 %	30.05.2048	1.483.363	0,38
1.000.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	392.465	0,10
2.090.000	White Capital Buyer LLC**	6,88 %	15.10.2028	1.811.286	0,46
2.600.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	2.105.402	0,53
500.000	XP Inc**	3,25 %	01.07.2026	449.985	0,11
312.500	YPF SA*	8,50 %	23.03.2025	285.569	0,07
900.000	YPF SA*	8,50 %	28.07.2025	756.205	0,19
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>250.001.101</b>	<b>63,37</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>316.164.124</b>	<b>80,14</b>
<b>Staatsanleihen 2,49 % (31. Dezember 2021: 1,81 %)</b>					
<b>Euro</b>					
1.550.000	Ivory Coast Government International Bond	6,88 %	17.10.2040	1.257.197	0,32
904.000	Republic of Cameroon International Bond	5,95 %	07.07.2032	719.331	0,18
<b>Euro insgesamt</b>				<b>1.976.528</b>	<b>0,50</b>
<b>US-Dollar</b>					
1.250.000	Angolan Government International Bond	8,25 %	09.05.2028	1.143.789	0,29
1.002.000	Angolan Government International Bond	8,75 %	14.04.2032	871.287	0,22
436.000	Dominican Republic International Bond	5,30 %	21.01.2041	338.063	0,09
1.000.000	Dominican Republic International Bond	6,85 %	27.01.2045	871.978	0,22
928.000	Egypt Government International Bond	7,50 %	16.02.2061	575.805	0,15
800.000	Egypt Government International Bond	7,63 %	29.05.2032	594.637	0,15
579.000	Fondo MIVIVIENDA SA	4,63 %	12.04.2027	549.106	0,14
1.000.000	Ghana Government International Bond	10,75 %	14.10.2030	708.700	0,18
326.000	Guatemala Government Bond	5,25 %	10.08.2029	314.150	0,08
902.000	Republic of South Africa Government International Bond	7,30 %	20.04.2052	781.177	0,20
600.000	Sri Lanka Government International Bond	5,88 %	21.02.2023	198.083	0,05
1.000.000	Ukraine Government International Bond	0,00 %	01.08.2041	294.800	0,07
591.000	Ukraine Government International Bond	6,88 %	21.05.2031	115.245	0,03
1.000.000	Ukraine Government International Bond	7,38 %	25.09.2034	190.689	0,05
459.000	Ukraine Government International Bond	7,75 %	01.09.2028	99.259	0,02
417.000	Ukraine Government International Bond	7,75 %	01.09.2029	90.881	0,02
500.000	Ukraine Government International Bond	9,75 %	01.11.2030	103.610	0,03
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>7.841.259</b>	<b>1,99</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>9.817.787</b>	<b>2,49</b>

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Investmentfonds 0,08 % (31. Dezember 2021: 0,07 %)</b>			
<b>Britisches Pfund</b>			
394.721	NB Global Monthly Income Fund Ltd	338.564	0,08
<b>Investmentfonds insgesamt <sup>#</sup></b>		<b>338.564</b>	<b>0,08</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>355.646.850</b>	<b>90,14</b>

### Devisenterminkontrakte 7,36 % (31. Dezember 2021: 0,27 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
2.530.535 €	2.483.019 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	220.425	0,06
5.760.798 €	6.000.000 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	154.429	0,04
7.273.684 €	7.182.149 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	588.540	0,15
8.653.518 €	9.210.874 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	33.933	0,01
90.805 £	101.834 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	7.439	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CAD</i>						
74.796 CAD	54.338 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	868	0,00
13.800.738 CAD	10.099.053 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	87.077	0,02
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
31.591 €	32.955 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	794	0,00
4.166.541 €	4.154.964 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	21	296.271	0,07
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
3.316.825 £	3.692.011 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	299.379	0,08
318.279.193 £	357.884.959 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	5	25.124.798	6,37
9.867.387 £	11.491.043 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	383.139	0,10
79.695.454 US\$	64.700.466 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	1.836.423	0,46
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>29.033.515</b>	<b>7,36</b>

### Futures-Kontrakte 0,12 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
(723)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	323.099	0,08
(258)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2023	44.344	0,01
12	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	1.792	0,00
(62)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	46.984	0,01
(79)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	51.983	0,02
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>‡</sup></b>		<b>468.202</b>	<b>0,12</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>385.148.567</b>	<b>97,62</b>

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,75 %) (31. Dezember 2021: (0,44 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
2.265.413 US\$	2.277.360 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(167.558)	(0,04)
531.658 US\$	500.000 €	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(2.506)	(0,00)
72.143.623 US\$	73.063.078 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(5.911.802)	(1,50)
730 US\$	1.000 CAD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(8)	(0,00)
10.986.592 US\$	9.796.695 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(802.523)	(0,21)
2.360.269 US\$	2.258.672 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(52.736)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen CAD</i>						
421.185 CAD	316.010 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(5.139)	(0,00)
164.815 CAD	122.366 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(719)	(0,00)
275.416 US\$	379.075 CAD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(4.373)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
22.950 €	24.535 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(16)	(0,00)
24.907 US\$	25.384 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(2.211)	(0,00)
146.930 US\$	143.773 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	(6.667)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
7.016.215 £	8.573.176 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(130.027)	(0,03)
5.903.888 US\$	5.282.780 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(453.286)	(0,12)
82.694.481 US\$	71.476.231 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(3.318.350)	(0,84)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(10.857.921)</b>	<b>(2,75)</b>

### Futures-Kontrakte (0,13 %) (31. Dezember 2021: (0,34 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
40	Euro-Bund Future March 2023	(365.426)	(0,09)
(189)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	(150.529)	(0,04)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(515.955)</b>	<b>(0,13)</b>

### Total Return Swap-Kontrakte (0,16 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
USD 1.200.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup>	(29.717)	(0,01)
USD 23.800.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>3</sup>	(602.383)	(0,15)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>(632.100)</b>	<b>(0,16)</b>

<sup>1</sup> Benchmark für alle Total Return Swap-Kontrakte ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>3</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(12.005.976)</b>	<b>(3,04)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>373.142.591</b>	<b>94,58</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>21.383.738</b>	<b>5,42</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>394.526.329</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>		US\$	% des Gesamtver- mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	151.255.048	37,14
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	204.053.238	50,10
μ	Investmentfonds	338.564	0,08
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(47.753)	(0,01)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	17.543.494	4,31
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>373.142.591</b>	<b>91,62</b>

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %)</b>					
<b>Euro</b>					
800.000	Accor SA*	4,38 %	29.12.2049	805.901	0,24
1.131.000	Adevinta ASA*	2,63 %	15.11.2025	1.125.910	0,33
1.402.000	Adient Global Holdings Ltd*	3,50 %	15.08.2024	1.439.188	0,43
500.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	454.668	0,13
400.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	347.798	0,10
555.000	Altice France Holding SA*	8,00 %	15.05.2027	439.060	0,13
400.000	Altice France SA**	2,13 %	15.02.2025	378.967	0,11
788.000	Altice France SA**	4,25 %	15.10.2029	636.263	0,19
768.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	788.342	0,23
439.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	2,13 %	15.08.2026	393.281	0,12
1.493.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	1.367.851	0,41
350.000	Assemblin Financing AB**	7,05 %	15.05.2025	366.654	0,11
685.000	Avantor Funding Inc**	2,63 %	01.11.2025	691.472	0,20
500.000	Avis Budget Finance Plc**	4,75 %	30.01.2026	500.349	0,15
859.000	Banijay Entertainment SASU**	3,50 %	01.03.2025	865.546	0,26
856.000	Belden Inc*	3,38 %	15.07.2027	840.549	0,25
798.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25 %	30.04.2029	741.662	0,22
1.049.000	CAB SELAS**	3,38 %	01.02.2028	905.094	0,27
400.000	Canpack SA/Canpack US LLC*	2,38 %	01.11.2027	337.888	0,10
450.000	Castle UK Finco Plc**	7,01 %	15.05.2028	358.054	0,11
500.000	Chrome Bidco SASU*	3,50 %	31.05.2028	451.138	0,13
1.051.000	Constellium SE*	3,13 %	15.07.2029	893.822	0,26
400.000	Coty Inc**	3,88 %	15.04.2026	398.633	0,12
500.000	Cullinan Holdco Scsp**	4,63 %	15.10.2026	469.204	0,14
400.000	DKT Finance ApS**	7,00 %	17.06.2023	425.285	0,13
500.000	doValue SpA*	3,38 %	31.07.2026	472.832	0,14
100.000	doValue SpA**	5,00 %	04.08.2025	103.164	0,03
300.000	Dufry One BV**	2,00 %	15.02.2027	263.328	0,08
766.000	Dufry One BV*	3,38 %	15.04.2028	681.803	0,20
300.000	eG Global Finance Plc*	3,63 %	07.02.2024	304.610	0,09
198.000	eG Global Finance Plc*	6,25 %	30.10.2025	186.130	0,06
954.000	Emeria SASU**	3,38 %	31.03.2028	853.236	0,25
200.000	Faurecia SE*	2,63 %	15.06.2025	194.895	0,06
1.043.000	Faurecia SE*	2,75 %	15.02.2027	942.918	0,28
100.000	Faurecia SE*	7,25 %	15.06.2026	107.910	0,03
500.000	Ford Motor Credit Co LLC**	2,39 %	17.02.2026	488.848	0,15
800.000	Huhtamaki OYJ*	4,25 %	09.06.2027	837.874	0,25
500.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	496.391	0,15
750.000	Iliad Holding SASU**	5,63 %	15.10.2028	730.223	0,22
700.000	Infineon Technologies AG*	2,88 %	29.12.2049	698.067	0,21

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
200.000	Infineon Technologies AG*	3,63 %	29.12.2049	191.512	0,06
300.000	IQVIA Inc*	2,88 %	15.09.2025	309.710	0,09
1.001.000	IQVIA Inc**	2,88 %	15.06.2028	958.517	0,28
734.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	6,88 %	15.11.2026	699.405	0,21
800.000	Koninklijke KPN NV*	6,00 %	29.12.2049	854.761	0,25
1.331.000	LeasePlan Corp NV*	7,38 %	29.12.2049	1.410.382	0,42
1.868.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	1.794.295	0,53
100.000	Loxam SAS*	4,50 %	15.04.2027	90.058	0,03
683.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	626.176	0,18
199.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	149.088	0,04
500.000	Motion Bondco DAC*	4,50 %	15.11.2027	441.589	0,13
726.000	Motion Finco Sarl**	7,00 %	15.05.2025	775.465	0,23
699.000	NH Hotel Group SA*	4,00 %	02.07.2026	688.267	0,20
1.494.000	Novelis Sheet Ingot GmbH*	3,38 %	15.04.2029	1.371.022	0,41
868.000	Paganini Bidco SpA*	5,89 %	30.10.2028	896.729	0,27
100.000	Paprec Holding SA**	3,50 %	01.07.2028	92.927	0,03
465.000	Paprec Holding SA*	4,00 %	31.03.2025	481.242	0,14
313.000	PCF GmbH*	4,75 %	15.04.2026	278.335	0,08
250.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	1,00 %	12.08.2027	186.927	0,06
484.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,88 %	29.12.2049	206.337	0,06
649.000	SGL Carbon SE*	4,63 %	30.09.2024	689.811	0,20
760.000	SPCM SA*	2,63 %	01.02.2029	684.339	0,20
500.000	Standard Industries Inc**	2,25 %	21.11.2026	459.002	0,14
700.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75 %	31.10.2026	640.265	0,19
625.110	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	629.912	0,19
754.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	742.346	0,22
700.000	Telecom Italia SpA*	2,88 %	28.01.2026	683.081	0,20
1.400.000	Telefonica Europe BV*	4,38 %	29.12.2049	1.429.108	0,43
100.000	Telefonica Europe BV*	7,13 %	29.12.2049	109.272	0,03
857.000	TK Elevator Midco GmbH**	4,38 %	15.07.2027	817.307	0,24
400.000	Trivium Packaging Finance BV*	3,75 %	15.08.2026	391.681	0,12
550.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	426.411	0,13
1.366.000	Verisure Holding AB*	3,88 %	15.07.2026	1.325.706	0,39
800.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	654.598	0,19
400.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	360.852	0,11
1.100.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	855.397	0,25
<b>Euro insgesamt</b>				<b>47.186.640</b>	<b>14,00</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
616.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	595.464	0,18



## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>					
742.000	Bellis Acquisition Co Plc**	3,25 %	16.02.2026	729.014	0,22
100.000	Bellis Finco Plc**	4,00 %	16.02.2027	88.853	0,03
708.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	785.395	0,23
403.000	Maison Finco Plc**	6,00 %	31.10.2027	355.233	0,10
951.000	Marks & Spencer Plc*	3,75 %	19.05.2026	999.817	0,30
300.000	Marks & Spencer Plc*	6,00 %	12.06.2025	348.243	0,10
874.000	National Express Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	870.663	0,26
405.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38 %	15.02.2025	424.480	0,13
400.000	Travis Perkins Plc*	4,50 %	07.09.2023	474.892	0,14
200.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	5,00 %	15.04.2027	215.098	0,06
787.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	768.083	0,23
100.000	Zenith Finco Plc**	6,50 %	30.06.2027	94.295	0,03
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>6.749.530</b>	<b>2,01</b>
<b>US-Dollar</b>					
320.000	180 Medical Inc**	3,88 %	15.10.2029	275.566	0,08
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,45 %	24.01.2028	193.568	0,06
675.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,50 %	01.07.2028	641.318	0,19
250.000	Access Bank Plc*	6,13 %	21.09.2026	194.750	0,06
400.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	366.000	0,11
635.000	ADT Security Corp**	4,88 %	15.07.2032	540.768	0,16
240.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	226.661	0,07
800.000	Agile Group Holdings Ltd**	5,75 %	02.01.2025	428.312	0,13
695.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63 %	01.05.2028	559.506	0,17
840.000	Air Canada**	3,88 %	15.08.2026	745.443	0,22
747.000	Akbank TAS**	6,80 %	06.02.2026	723.455	0,21
280.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,50 %	15.03.2029	235.533	0,07
215.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,63 %	15.01.2027	200.180	0,06
265.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,88 %	15.02.2030	236.972	0,07
330.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	5,88 %	15.02.2028	314.292	0,09
520.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	4,25 %	15.10.2027	466.532	0,14
185.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	166.687	0,05
1.440.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer 144A**	6,75 %	15.10.2027	1.297.454	0,39
856.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	850.196	0,25
755.000	Altice France Holding SA**	10,50 %	15.05.2027	577.311	0,17
1.410.000	Altice France SA*	5,50 %	15.01.2028	1.107.231	0,33
270.000	AMC Networks Inc**	4,25 %	15.02.2029	168.633	0,05
855.000	Amkor Technology Inc**	6,63 %	15.09.2027	847.518	0,25
550.000	Amsted Industries Inc**	5,63 %	01.07.2027	523.938	0,16
165.000	AmWINS Group Inc**	4,88 %	30.06.2029	140.159	0,04

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
735.000	AmWINS Group Inc 144A**	4,88 %	30.06.2029	624.343 0,19
745.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75 %	01.03.2027	705.573 0,21
80.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp REG**	5,75 %	01.03.2027	75.745 0,02
1.290.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	1.070.038 0,32
545.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	525.435 0,16
200.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd <sup>†</sup>	5,63 %	07.10.2026	182.075 0,05
120.000	Aramark Services Inc**	5,00 %	01.02.2028	112.196 0,03
185.000	ARD Finance SA <sup>†</sup>	6,50 %	30.06.2027	129.069 0,04
30.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	4,00 %	01.09.2029	23.832 0,01
465.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	455.788 0,14
110.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	82.425 0,03
865.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc 144A**	5,25 %	15.08.2027	648.164 0,19
120.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	107.152 0,03
2.555.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp 144A**	5,88 %	30.06.2029	2.281.436 0,68
1.810.000	ASGN Inc**	4,63 %	15.05.2028	1.641.616 0,48
1.010.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	832.583 0,25
760.000	Avantor Funding Inc**	3,88 %	01.11.2029	639.179 0,19
575.000	Avantor Funding Inc**	4,63 %	15.07.2028	523.664 0,16
720.000	Avient Corp**	7,13 %	01.08.2030	704.795 0,21
840.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38 %	01.03.2029	719.660 0,21
55.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,75 %	15.07.2027	49.972 0,02
950.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc 144A**	5,75 %	15.07.2027	863.151 0,26
555.000	Ball Corp <sup>†</sup>	4,00 %	15.11.2023	544.871 0,16
350.000	Ball Corp <sup>†</sup>	4,88 %	15.03.2026	339.622 0,10
200.000	Banco Davivienda SA**	6,65 %	29.12.2049	154.500 0,05
747.000	Banco do Brasil SA**	9,00 %	29.12.2049	748.580 0,22
856.000	Banco Mercantil del Norte SA <sup>†</sup>	7,50 %	29.12.2049	785.607 0,23
200.000	Bancolombia SA <sup>†</sup>	4,63 %	18.12.2029	176.109 0,05
747.000	BBVA Bancomer SA**	5,88 %	13.09.2034	690.892 0,20
1.445.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63 %	01.05.2027	1.297.653 0,38
275.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,13 %	15.05.2029	228.873 0,07
930.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,50 %	15.11.2026	870.293 0,26
1.140.000	Berry Global Inc**	4,50 %	15.02.2026	1.090.994 0,32
670.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	6,63 %	15.07.2026	649.578 0,19
342.000	Braskem Idesa SAPI**	6,99 %	20.02.2032	242.931 0,07
250.000	Braskem Netherlands Finance BV**	8,50 %	23.01.2081	242.637 0,07
1.100.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88 %	15.04.2029	937.619 0,28
65.000	Buckeye Partners LP**	4,13 %	01.03.2025	62.038 0,02
795.000	Buckeye Partners LP 144A**	4,13 %	01.03.2025	758.394 0,23
535.000	Buckeye Partners LP**	4,15 %	01.07.2023	526.449 0,16

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
525.000	Buckeye Partners LP**	4,50 %	01.03.2028	462.287 0,14
295.000	Builders FirstSource Inc**	4,25 %	01.02.2032	239.682 0,07
345.000	Builders FirstSource Inc**	6,38 %	15.06.2032	324.506 0,10
250.000	C&W Senior Financing DAC**	6,88 %	15.09.2027	233.045 0,07
1.110.000	Cablevision Lightpath LLC**	5,63 %	15.09.2028	826.647 0,25
950.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	872.979 0,26
228.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	201.726 0,06
840.000	Carpenter Technology Corp*	6,38 %	15.07.2028	800.348 0,24
65.000	Cars.com Inc**	6,38 %	01.11.2028	57.817 0,02
275.000	Cars.com Inc 144A**	6,38 %	01.11.2028	244.609 0,07
230.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,13 %	15.02.2029	183.425 0,05
35.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,50 %	01.04.2030	27.680 0,01
675.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	5,00 %	15.07.2027	629.146 0,19
2.725.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.06.2033	2.096.193 0,62
730.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	664.442 0,20
720.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,13 %	01.05.2027	672.674 0,20
705.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,50 %	01.05.2026	683.660 0,20
345.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	6,38 %	01.09.2029	324.875 0,10
280.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	5,50 %	01.05.2025	277.434 0,08
705.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	6,50 %	01.10.2028	682.983 0,20
747.000	Cemex SAB de CV**	7,38 %	05.06.2027	767.827 0,23
280.000	Centene Corp*	2,50 %	01.03.2031	219.632 0,07
330.000	Centene Corp*	3,00 %	15.10.2030	271.261 0,08
220.000	Centene Corp**	4,63 %	15.12.2029	201.540 0,06
200.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	186.847 0,05
535.000	Central Parent Inc/CDK Global Inc**	7,25 %	15.06.2029	523.977 0,15
1.475.000	Century Aluminum Co**	7,50 %	01.04.2028	1.278.232 0,38
1.105.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	1.112.227 0,33
230.000	Chart Industries Inc**	9,50 %	01.01.2031	236.167 0,07
2.080.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00 %	15.01.2029	1.742.582 0,52
650.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00 %	15.03.2026	593.125 0,18
730.000	Ciena Corp**	4,00 %	31.01.2030	643.411 0,19
305.000	Clarios Global LP**	6,75 %	15.05.2025	306.150 0,09
350.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	6,25 %	15.05.2026	342.637 0,10
840.000	Clearway Energy Operating LLC**	4,75 %	15.03.2028	776.576 0,23
870.000	CommScope Inc**	4,75 %	01.09.2029	703.025 0,21
400.000	CommScope Inc**	7,13 %	01.07.2028	286.598 0,09
105.000	CommScope Inc**	8,25 %	01.03.2027	81.541 0,02
415.000	CommScope Technologies LLC**	6,00 %	15.06.2025	378.505 0,11
400.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	343.539 0,10

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.405.000	Comstock Resources Inc**	5,88 %	15.01.2030	1.209.705	0,36
75.000	Comstock Resources Inc**	6,75 %	01.03.2029	67.823	0,02
125.000	Condor Merger Sub Inc**	7,38 %	15.02.2030	100.759	0,03
1.140.000	Condor Merger Sub Inc 144A**	7,38 %	15.02.2030	918.630	0,27
193.500	Continuum Energy Levanter Pte Ltd*	4,50 %	09.02.2027	173.914	0,05
1.115.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13 %	15.01.2029	787.045	0,23
215.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	204.177	0,06
175.000	Coty Inc**	6,50 %	15.04.2026	168.271	0,05
800.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	2,70 %	12.07.2026	458.016	0,13
640.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	560.243	0,17
45.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**	5,63 %	01.05.2027	41.927	0,01
625.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp 144A**	5,63 %	01.05.2027	582.325	0,17
645.000	CSC Holdings LLC**	4,50 %	15.11.2031	448.719	0,13
580.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	540.850	0,16
585.000	CSC Holdings LLC**	5,38 %	01.02.2028	472.581	0,14
490.000	CSC Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2027	412.103	0,12
475.000	CSC Holdings LLC**	5,75 %	15.01.2030	268.943	0,08
3.080.000	CSC Holdings LLC 144A**	5,75 %	15.01.2030	1.743.881	0,52
425.000	Dana Inc*	4,50 %	15.02.2032	340.463	0,10
670.000	DaVita Inc**	3,75 %	15.02.2031	501.532	0,15
635.000	DaVita Inc**	4,63 %	01.06.2030	512.154	0,15
930.000	Delta Air Lines Inc*	7,38 %	15.01.2026	951.734	0,28
399.000	Ecopetrol SA*	6,88 %	29.04.2030	362.738	0,11
720.000	Element Solutions Inc**	3,88 %	01.09.2028	613.152	0,18
300.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	296.443	0,09
420.000	Encompass Health Corp*	4,50 %	01.02.2028	382.179	0,11
400.000	Encompass Health Corp*	5,75 %	15.09.2025	395.879	0,12
210.000	Endeavour Mining Plc*	5,00 %	14.10.2026	180.873	0,05
911.929	Energear Israel Finance Ltd*	5,38 %	30.03.2028	819.596	0,24
260.000	Energizer Holdings Inc**	6,50 %	31.12.2027	247.764	0,07
600.000	EnerSys**	4,38 %	15.12.2027	542.805	0,16
425.000	EnLink Midstream LLC**	6,50 %	01.09.2030	421.196	0,12
380.000	EnLink Midstream Partners LP*	5,05 %	01.04.2045	288.649	0,09
305.000	EnLink Midstream Partners LP*	5,45 %	01.06.2047	245.533	0,07
55.000	EnLink Midstream Partners LP*	5,60 %	01.04.2044	45.620	0,01
2.450.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50 %	01.07.2027	2.345.875	0,70
205.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	201.020	0,06
230.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2030	221.927	0,07
400.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	15.10.2027	376.113	0,11
765.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	746.181	0,22

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
370.000	FirstEnergy Corp <sup>*</sup>	4,40 %	15.07.2027	345.006	0,10
370.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>	5,13 %	15.05.2024	364.281	0,11
580.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>	5,88 %	15.04.2030	541.124	0,16
495.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>	6,13 %	15.04.2032	462.352	0,14
650.000	Ford Motor Co <sup>*</sup>	3,25 %	12.02.2032	488.619	0,15
815.000	Ford Motor Co <sup>*</sup>	5,29 %	08.12.2046	622.954	0,18
1.365.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>	2,90 %	10.02.2029	1.092.048	0,32
1.115.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>	3,37 %	17.11.2023	1.089.100	0,32
575.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>	4,06 %	01.11.2024	553.306	0,17
600.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>	4,13 %	17.08.2027	538.377	0,16
1.780.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>	4,69 %	09.06.2025	1.696.672	0,50
370.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>	7,35 %	04.11.2027	380.064	0,11
1.725.000	Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>	5,88 %	15.10.2027	1.605.578	0,48
990.000	Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>	6,75 %	01.05.2029	820.344	0,24
400.000	FS Luxembourg Sarl <sup>**</sup>	10,00 %	15.12.2025	402.304	0,12
315.000	Gen Digital Inc <sup>**</sup>	6,75 %	30.09.2027	309.110	0,09
265.000	Gen Digital Inc <sup>**</sup>	7,13 %	30.09.2030	260.720	0,08
1.600.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp <sup>*</sup>	8,00 %	15.01.2027	1.513.312	0,45
805.000	GFL Environmental Inc <sup>**</sup>	4,25 %	01.06.2025	770.318	0,23
490.000	Global Infrastructure Solutions Inc <sup>**</sup>	7,50 %	15.04.2032	388.521	0,11
336.000	Gol Finance SA <sup>*</sup>	7,00 %	31.01.2025	149.241	0,05
260.000	Goodyear Tire & Rubber Co <sup>**</sup>	4,88 %	15.03.2027	238.209	0,07
155.000	Goodyear Tire & Rubber Co <sup>**</sup>	5,00 %	31.05.2026	146.463	0,04
475.000	Goodyear Tire & Rubber Co <sup>**</sup>	5,00 %	15.07.2029	396.838	0,12
710.000	Goodyear Tire & Rubber Co <sup>**</sup>	5,25 %	15.07.2031	581.660	0,17
430.000	Goodyear Tire & Rubber Co <sup>**</sup>	9,50 %	31.05.2025	442.527	0,13
286.396	Greenko Power II Ltd <sup>*</sup>	4,30 %	13.12.2028	240.523	0,07
2.130.000	GTCR AP Finance Inc <sup>**</sup>	8,00 %	15.05.2027	2.043.650	0,61
930.000	GYP Holdings III Corp <sup>**</sup>	4,63 %	01.05.2029	760.524	0,23
635.000	Hanesbrands Inc <sup>**</sup>	4,88 %	15.05.2026	568.529	0,17
755.000	Harsco Corp <sup>**</sup>	5,75 %	31.07.2027	597.316	0,18
1.315.000	Hertz Corp <sup>**</sup>	5,00 %	01.12.2029	999.269	0,30
215.000	Hologic Inc <sup>**</sup>	4,63 %	01.02.2028	203.095	0,06
200.000	Huarong Finance II Co Ltd <sup>*</sup>	5,50 %	16.01.2025	189.763	0,06
660.000	HUB International Ltd <sup>**</sup>	5,63 %	01.12.2029	577.290	0,17
1.440.000	HUB International Ltd <sup>**</sup>	7,00 %	01.05.2026	1.412.669	0,42
85.000	Hudbay Minerals Inc <sup>**</sup>	4,50 %	01.04.2026	77.313	0,02
835.000	Hudbay Minerals Inc <sup>**</sup>	6,13 %	01.04.2029	757.499	0,22
540.000	IAA Inc <sup>**</sup>	5,50 %	15.06.2027	527.620	0,16
320.000	iHeartCommunications Inc <sup>**</sup>	6,38 %	01.05.2026	294.906	0,09

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
255.000	iHeartCommunications Inc**	8,38 %	01.05.2027	217.384	0,06
200.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	176.738	0,05
635.000	Ingevity Corp**	3,88 %	01.11.2028	547.142	0,16
560.000	IQVIA Inc**	5,00 %	15.10.2026	535.948	0,16
2.200.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2027	2.026.706	0,60
635.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2029	554.914	0,17
145.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	125.917	0,04
900.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	781.552	0,23
300.000	Itau Unibanco Holding SA**	4,63 %	29.12.2049	239.509	0,07
1.015.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	856.675	0,26
1.375.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	1.037.094	0,31
324.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	257.023	0,08
1.450.000	KB Home*	4,80 %	15.11.2029	1.263.233	0,37
285.000	KB Home*	6,88 %	15.06.2027	287.186	0,09
645.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	627.546	0,19
345.000	Kinetik Holdings LP**	5,88 %	15.06.2030	324.001	0,10
335.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2027	340.221	0,10
270.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	275.257	0,08
170.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	145.463	0,04
555.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC 144A**	4,25 %	01.07.2029	474.896	0,14
1.115.000	Legacy LifePoint Health LLC**	4,38 %	15.02.2027	944.851	0,28
55.000	Legacy LifePoint Health LLC**	6,75 %	15.04.2025	51.847	0,01
265.000	Legacy LifePoint Health LLC 144A**	6,75 %	15.04.2025	249.808	0,07
950.000	Level 3 Financing Inc**	4,25 %	01.07.2028	750.481	0,22
135.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	112.624	0,04
770.000	Level 3 Financing Inc 144A**	4,63 %	15.09.2027	642.372	0,19
685.000	Lindblad Expeditions LLC**	6,75 %	15.02.2027	622.268	0,18
55.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,75 %	15.10.2027	49.133	0,01
395.000	Live Nation Entertainment Inc 144A**	4,75 %	15.10.2027	352.291	0,10
1.225.000	LPL Holdings Inc**	4,00 %	15.03.2029	1.067.526	0,32
440.000	LPL Holdings Inc**	4,63 %	15.11.2027	411.752	0,12
355.000	Lumen Technologies Inc**	4,50 %	15.01.2029	245.503	0,07
250.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	01.04.2029	221.718	0,07
550.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	15.03.2030	478.060	0,14
692.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	534.570	0,15
640.000	Masonite International Corp**	3,50 %	15.02.2030	518.545	0,15
1.605.000	Masonite International Corp**	5,38 %	01.02.2028	1.486.760	0,44
230.000	Mattamy Group Corp**	4,63 %	01.03.2030	186.821	0,06
160.000	Mattamy Group Corp**	5,25 %	15.12.2027	142.173	0,04
805.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,25 %	15.04.2025	746.055	0,22

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
579.751	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	479.198	0,14
405.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	340.943	0,10
40.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	33.131	0,01
575.000	McGraw-Hill Education Inc 144A**	8,00 %	01.08.2029	476.254	0,14
1.990.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	1.607.413	0,48
2.490.000	Medline Borrower LP**	5,25 %	01.10.2029	1.982.177	0,59
730.000	Meritage Homes Corp*	5,13 %	06.06.2027	687.607	0,20
672.300	Millicom International Cellular SA*	6,25 %	25.03.2029	643.981	0,19
668.000	Minerva Luxembourg SA*	4,38 %	18.03.2031	548.796	0,16
595.000	MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp**	5,50 %	01.02.2030	474.483	0,14
315.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,50 %	01.09.2028	246.374	0,07
1.395.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75 %	01.11.2028	930.761	0,28
270.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	3,50 %	15.03.2031	185.645	0,06
1.260.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	1.061.878	0,32
1.450.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,25 %	01.08.2026	1.322.987	0,39
421.000	MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA**	6,88 %	01.02.2025	285.905	0,08
120.000	Mueller Water Products Inc**	4,00 %	15.06.2029	105.603	0,03
380.000	NCL Corp Ltd**	3,63 %	15.12.2024	325.256	0,10
580.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.02.2027	503.124	0,15
285.000	NCL Finance Ltd**	6,13 %	15.03.2028	210.749	0,06
793.000	Nemak SAB de CV**	3,63 %	28.06.2031	621.458	0,19
1.565.000	New Fortress Energy Inc**	6,75 %	15.09.2025	1.483.808	0,44
515.000	NextEra Energy Operating Partners LP**	3,88 %	15.10.2026	472.252	0,14
75.000	NextEra Energy Operating Partners LP**	4,50 %	15.09.2027	68.774	0,02
815.000	NextEra Energy Operating Partners LP 144A**	4,50 %	15.09.2027	748.975	0,22
265.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	10,75 %	01.06.2028	247.896	0,07
295.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88 %	01.06.2024	286.089	0,09
830.000	NOVA Chemicals Corp**	5,00 %	01.05.2025	782.865	0,23
595.000	Occidental Petroleum Corp*	4,40 %	15.04.2046	465.763	0,14
350.000	Occidental Petroleum Corp**	4,50 %	15.07.2044	280.387	0,08
395.000	Occidental Petroleum Corp*	6,13 %	01.01.2031	399.390	0,12
505.000	Occidental Petroleum Corp**	6,45 %	15.09.2036	516.239	0,15
270.000	Occidental Petroleum Corp*	6,63 %	01.09.2030	279.621	0,08
415.000	Olympus Water US Holding Corp**	6,25 %	01.10.2029	315.610	0,09
305.000	Olympus Water US Holding Corp**	7,13 %	01.10.2027	292.432	0,09
1.265.000	OneMain Finance Corp*	3,50 %	15.01.2027	1.048.963	0,31
760.000	OneMain Finance Corp*	5,38 %	15.11.2029	622.866	0,18
1.355.000	OneMain Finance Corp*	6,63 %	15.01.2028	1.250.096	0,37
480.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	462.194	0,14
480.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	457.493	0,14

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
480.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV**	4,13 %	30.04.2028	425.832 0,13
720.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV**	5,13 %	30.04.2031	624.698 0,18
150.000	Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**	6,25 %	15.06.2025	148.837 0,04
747.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	751.695 0,22
30.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**	4,00 %	15.10.2027	26.659 0,01
400.000	Pampa Energia SA*	7,50 %	24.01.2027	367.001 0,11
680.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	5,88 %	01.10.2028	617.505 0,18
1.020.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	7,50 %	01.06.2025	1.021.000 0,30
1.010.000	Performance Food Group Inc**	4,25 %	01.08.2029	876.478 0,26
105.000	Performance Food Group Inc**	5,50 %	15.10.2027	99.255 0,03
930.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp.**	7,75 %	15.02.2029	875.193 0,26
1.810.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	1.680.875 0,50
1.865.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	1.799.165 0,53
1.125.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	1.026.247 0,31
645.000	Rackspace Technology Global Inc**	3,50 %	15.02.2028	375.629 0,11
240.000	Rackspace Technology Global Inc**	5,38 %	01.12.2028	103.820 0,03
900.000	Rackspace Technology Global Inc 144A**	5,38 %	01.12.2028	393.729 0,12
2.185.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	1.596.820 0,47
1.545.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75 %	15.01.2029	1.170.631 0,35
400.000	Resideo Funding Inc**	4,00 %	01.09.2029	324.008 0,10
390.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,50 %	15.02.2029	336.909 0,10
1.010.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75 %	15.10.2027	915.627 0,27
345.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc**	5,38 %	15.01.2025	339.556 0,10
580.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,38 %	15.07.2027	470.352 0,14
560.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	31.08.2026	471.800 0,14
655.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	523.882 0,15
1.125.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	8,25 %	15.01.2029	1.132.031 0,34
305.000	Royal Caribbean Cruises Ltd*	9,25 %	15.01.2029	313.786 0,09
300.000	Rumo Luxembourg Sarl**	5,25 %	10.01.2028	284.625 0,09
275.000	Ryan Specialty Group LLC**	4,38 %	01.02.2030	238.465 0,07
777.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	707.143 0,21
2.110.000	Sensata Technologies BV**	4,00 %	15.04.2029	1.822.724 0,54
90.000	Sensata Technologies BV**	5,00 %	01.10.2025	88.050 0,03
275.000	Sensata Technologies BV 144A**	5,00 %	01.10.2025	269.041 0,08
495.000	Sensata Technologies BV**	5,88 %	01.09.2030	469.839 0,14
300.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	242.711 0,07
40.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	15.02.2028	34.988 0,01
281.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	270.651 0,08
400.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	314.422 0,09
400.000	Simpar Europe SA**	5,20 %	26.01.2031	303.532 0,09



## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
630.000	Sirius XM Radio Inc**	3,13 %	01.09.2026	560.187	0,17
685.000	Sirius XM Radio Inc**	3,88 %	01.09.2031	535.734	0,16
1.335.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00 %	01.08.2027	1.236.959	0,37
555.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	500.721	0,15
240.000	Six Flags Theme Parks Inc**	7,00 %	01.07.2025	242.026	0,07
2.145.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	2.136.098	0,63
520.000	Southwestern Energy Co*	4,75 %	01.02.2032	445.388	0,13
415.000	SPCM SA**	3,13 %	15.03.2027	357.417	0,11
505.000	Sprint Capital Corp**	6,88 %	15.11.2028	525.298	0,16
295.000	Sprint Capital Corp**	8,75 %	15.03.2032	351.745	0,10
655.000	Sprint LLC**	7,88 %	15.09.2023	665.602	0,20
1.225.000	SPX FLOW Inc**	8,75 %	01.04.2030	967.701	0,29
1.650.000	SRS Distribution Inc**	6,13 %	01.07.2029	1.336.203	0,40
825.000	Standard Industries Inc**	3,38 %	15.01.2031	622.535	0,18
670.000	Standard Industries Inc**	5,00 %	15.02.2027	619.226	0,18
610.000	Starwood Property Trust Inc**	3,63 %	15.07.2026	534.510	0,16
360.000	Starwood Property Trust Inc**	3,75 %	31.12.2024	338.461	0,10
300.000	Starwood Property Trust Inc**	4,38 %	15.01.2027	262.949	0,08
355.000	Starwood Property Trust Inc**	4,75 %	15.03.2025	339.369	0,10
2.045.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	8,50 %	15.10.2026	1.950.603	0,58
2.015.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	1.802.700	0,53
1.460.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	1.264.404	0,38
900.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,13 %	01.08.2030	781.208	0,23
730.000	Taylor Morrison Communities Inc**	6,63 %	15.07.2027	709.786	0,21
95.000	Team Health Holdings Inc**	6,38 %	01.02.2025	54.893	0,02
870.000	Team Health Holdings Inc 144A**	6,38 %	01.02.2025	502.703	0,15
330.000	Telecom Italia Capital SA**	7,20 %	18.07.2036	268.475	0,08
900.000	Tenet Healthcare Corp**	4,88 %	01.01.2026	852.906	0,25
745.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	668.585	0,20
920.000	TerraForm Power Operating LLC**	5,00 %	31.01.2028	829.573	0,25
185.000	TK Elevator US Newco Inc**	5,25 %	15.07.2027	164.576	0,05
745.000	T-Mobile USA Inc**	2,63 %	15.04.2026	684.119	0,20
747.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	584.911	0,17
545.000	TransDigm Inc*	4,63 %	15.01.2029	480.159	0,14
120.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	118.607	0,04
1.840.000	TransDigm Inc 144A**	6,25 %	15.03.2026	1.818.638	0,54
640.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	634.232	0,19
280.000	TreeHouse Foods Inc*	4,00 %	01.09.2028	238.448	0,07
470.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*	5,88 %	15.06.2024	468.442	0,14
800.000	Tri Pointe Homes Inc*	5,70 %	15.06.2028	725.977	0,22

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 81,02 % (31. Dezember 2021: 95,47 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
835.000	Trident TPI Holdings Inc**	9,25 %	01.08.2024	799.397	0,24
580.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	533.070	0,16
900.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	827.194	0,24
200.000	Turk Telekomunikasyon AS*	4,88 %	19.06.2024	188.827	0,06
200.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	173.864	0,05
75.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	69.647	0,02
695.000	United Airlines Inc 144A**	4,38 %	15.04.2026	645.395	0,19
1.230.000	United Airlines Inc**	4,63 %	15.04.2029	1.073.114	0,32
1.310.000	United Rentals North America Inc*	3,75 %	15.01.2032	1.070.440	0,32
215.000	United Rentals North America Inc*	3,88 %	15.02.2031	180.717	0,05
145.000	United Rentals North America Inc*	4,88 %	15.01.2028	137.729	0,04
270.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,88 %	15.02.2025	261.933	0,08
630.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	4,75 %	15.04.2028	504.923	0,15
850.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50 %	15.02.2029	564.715	0,17
1.525.000	Univar Solutions USA Inc**	5,13 %	01.12.2027	1.448.857	0,43
520.000	US Foods Inc**	4,75 %	15.02.2029	462.332	0,14
415.000	US Foods Inc**	6,25 %	15.04.2025	411.333	0,12
160.000	USI Inc**	6,88 %	01.05.2025	154.388	0,05
395.000	Valvoline Inc**	4,25 %	15.02.2030	383.861	0,11
400.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	348.857	0,10
320.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC**	4,13 %	15.08.2031	273.200	0,08
630.000	Vibrantz Technologies Inc**	9,00 %	15.02.2030	476.255	0,14
710.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	5,50 %	15.05.2029	637.626	0,19
1.555.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	1.248.860	0,37
720.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	650.462	0,19
1.200.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38 %	01.05.2029	1.036.358	0,31
305.000	Vistra Operations Co LLC**	5,50 %	01.09.2026	294.339	0,09
535.000	Vistra Operations Co LLC**	5,63 %	15.02.2027	508.712	0,15
1.170.000	VM Consolidated Inc**	5,50 %	15.04.2029	1.032.010	0,31
650.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,25 %	31.01.2031	527.650	0,16
501.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	196.625	0,06
1.305.000	White Capital Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	1.129.791	0,34
370.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	01.10.2024	364.964	0,11
1.450.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	1.174.167	0,35
340.000	Zayo Group Holdings Inc**	4,00 %	01.03.2027	251.845	0,08
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>219.069.164</b>	<b>65,01</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>273.005.334</b>	<b>81,02</b>

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,31 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
875.000	Asurion LLC	9,63 %	31.01.2028	687.601	0,21
329.167	Starwood Property Mortgage LLC	7,63 %	26.07.2026	325.875	0,10
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt <sup>†</sup></b>				<b>1.013.476</b>	<b>0,31</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>274.018.810</b>	<b>81,33</b>

Devisenterminkontrakte 3,82 % (31. Dezember 2021: 1,57 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
13.578 €	14.500 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	6	0,00
16.023.774 €	16.077.172 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	1.041.496	0,31
2.664.581 £	3.040.484 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	166.010	0,05
1.283.998 US\$	1.053.893 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	15.768	0,00
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
1.277 AUD	831 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	36	0,00
39.608 AUD	25.686 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	1.190	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
784.491 CHF	840.998 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	8.269	0,00
57.601.758 CHF	59.056.492 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	52	3.301.502	0,99
499.800 US\$	460.911 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	830	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
434.228 €	434.072 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	29.826	0,01
100.170.201 €	99.718.220 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	43	7.296.538	2,17
4.238 US\$	3.967 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
6.409.750 £	7.218.347 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	494.997	0,15
7.116.687 £	8.049.522 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	39	514.535	0,14
99.044 US\$	82.061 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	294	0,00
312.766 US\$	258.048 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	26	2.233	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>12.873.530</b>	<b>3,82</b>

Total Return Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
USD 37.700.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup>	12.816	0,00
USD 250.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup>	595	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>13.411</b>	<b>0,00</b>

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert % des Netto- US\$ vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>286.905.751 85,15</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (2,80 %) (31. Dezember 2021: (2,41 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
970.415 US\$	975.710 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(71.965)	(0,02)
60.210.010 US\$	60.173.320 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(4.074.909)	(1,21)
8.051.307 US\$	7.179.059 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(587.805)	(0,18)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
288 AUD	196 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(1)	(0,00)
626 US\$	965 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(30)	(0,00)
186 US\$	286 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(8)	(0,00)
292 US\$	447 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(11)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
34 CHF	37 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	(0,00)
21.283.694 US\$	20.986.475 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	64	(1.435.650)	(0,43)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
334.161 US\$	314.788 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(2.136)	(0,00)
344.317 US\$	322.355 €	18.01.2023	UBS AG	1	(65)	(0,00)
42.857.291 US\$	42.944.075 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	82	(3.021.123)	(0,90)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
90.970 £	111.565 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	(2.093)	(0,00)
119.168 US\$	107.449 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(10.134)	(0,00)
5.946.602 US\$	5.124.685 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	40	(220.324)	(0,06)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(9.426.254)</b>	<b>(2,80)</b>

	Zeitwert % des Netto- US\$ vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(9.426.254) (2,80)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>277.479.497 82,35</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>59.473.881 17,65</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>336.953.378 100,00</b>

## Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	75.343.596	17,89
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	197.661.738	46,94
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	1.013.476	0,24
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	3.460.687	0,82
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>277.479.497</b>	<b>65,89</b>

## Global High Yield Sustainable Action - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 95,99 % (31. Dezember 2021: 95,28 %)</b>					
<b>Euro</b>					
100.000	Accor SA*	4,38 %	29.12.2049	100.738	0,67
100.000	Adevinta ASA*	2,63 %	15.11.2025	99.550	0,66
100.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	90.934	0,60
100.000	Altice France SA*	2,50 %	15.01.2025	96.235	0,64
100.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	91.618	0,61
100.000	Assemblin Financing AB**	7,05 %	15.05.2025	104.758	0,70
100.000	Banijay Entertainment SASU**	3,50 %	01.03.2025	100.762	0,67
100.000	Belden Inc*	3,38 %	15.07.2027	98.195	0,65
100.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25 %	30.04.2029	92.940	0,62
100.000	Canpack SA/Canpack US LLC*	2,38 %	01.11.2027	84.472	0,56
100.000	Castle UK Finco Plc**	7,01 %	15.05.2028	79.568	0,53
100.000	Chrome Holdco SASU*	5,00 %	31.05.2029	83.299	0,55
100.000	Constellium SE*	3,13 %	15.07.2029	85.045	0,56
100.000	DKT Finance Aps**	7,00 %	17.06.2023	106.321	0,71
100.000	doValue SpA*	3,38 %	31.07.2026	94.566	0,63
100.000	eG Global Finance Plc*	3,63 %	07.02.2024	101.537	0,67
100.000	Faurecia SE*	2,75 %	15.02.2027	90.404	0,60
100.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00 %	31.03.2029	82.626	0,55
100.000	Huhtamaki OYJ*	4,25 %	09.06.2027	104.734	0,70
100.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	99.278	0,66
100.000	Infineon Technologies AG*	3,63 %	29.12.2049	95.756	0,64
100.000	Intrum AB*	3,50 %	15.07.2026	90.144	0,60
100.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	96.054	0,64
100.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	74.919	0,50
100.000	NH Hotel Group SA*	4,00 %	02.07.2026	98.464	0,65
100.000	Nomad Foods Bondco Plc*	2,50 %	24.06.2028	91.093	0,61
100.000	Paganini Bidco SpA*	5,89 %	30.10.2028	103.310	0,69
100.000	Paprec Holding SA*	4,00 %	31.03.2025	103.493	0,69
100.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50 %	15.02.2025	93.711	0,62
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,63 %	29.12.2049	42.050	0,28
175.000	SGL Carbon SE*	4,63 %	30.09.2024	186.004	1,24
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	98.454	0,65
100.000	Telecom Italia SpA**	1,63 %	18.01.2029	82.108	0,55
100.000	Telefonica Europe BV*	4,38 %	29.12.2049	102.079	0,68
101.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75 %	15.04.2029	80.348	0,53
100.000	United Group BV**	6,52 %	01.02.2029	92.754	0,62
100.000	Verisure Holding AB*	3,88 %	15.07.2026	97.050	0,64
100.000	Virgin Media Finance Plc**	3,75 %	15.07.2030	82.810	0,55
200.000	ZF Finance GmbH*	2,25 %	03.05.2028	167.732	1,11
<b>Euro insgesamt</b>				<b>3.765.913</b>	<b>25,03</b>

## Global High Yield Sustainable Action - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 95,99 % (31. Dezember 2021: 95,28 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britisches Pfund</b>					
100.000	AA Bond Co Ltd <sup>*</sup>	6,50 %	31.01.2026	96.666	0,64
100.000	Bellis Finco Plc <sup>**</sup>	4,00 %	16.02.2027	88.853	0,59
100.000	CPUK Finance Ltd <sup>**</sup>	6,50 %	28.08.2026	110.932	0,74
100.000	Maison Finco Plc <sup>**</sup>	6,00 %	31.10.2027	88.147	0,59
100.000	Marks & Spencer Plc <sup>*</sup>	3,75 %	19.05.2026	105.133	0,70
100.000	National Express Group Plc <sup>*</sup>	4,25 %	29.12.2049	99.618	0,66
103.000	Premier Foods Finance Plc <sup>*</sup>	3,50 %	15.10.2026	109.148	0,72
100.000	Zenith Finco Plc <sup>**</sup>	6,50 %	30.06.2027	94.295	0,63
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>792.792</b>	<b>5,27</b>
<b>US-Dollar</b>					
100.000	Acadia Healthcare Co Inc <sup>**</sup>	5,50 %	01.07.2028	95.010	0,63
230.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC <sup>**</sup>	5,88 %	15.02.2028	219.052	1,46
65.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer <sup>**</sup>	4,25 %	15.10.2027	58.317	0,39
25.000	Ally Financial Inc <sup>*</sup>	5,75 %	20.11.2025	24.245	0,16
70.000	Altice France Holding SA <sup>**</sup>	6,00 %	15.02.2028	41.471	0,28
55.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd <sup>**</sup>	5,50 %	20.04.2026	52.972	0,35
70.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd <sup>**</sup>	5,75 %	20.04.2029	63.980	0,43
20.000	American Axle & Manufacturing Inc <sup>*</sup>	6,88 %	01.07.2028	17.863	0,12
45.000	AmWINS Group Inc <sup>**</sup>	4,88 %	30.06.2029	38.225	0,25
100.000	APi Group DE Inc <sup>**</sup>	4,13 %	15.07.2029	83.000	0,55
55.000	APX Group Inc <sup>**</sup>	5,75 %	15.07.2029	45.622	0,30
170.000	APX Group Inc <sup>**</sup>	6,75 %	15.02.2027	163.897	1,09
80.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc <sup>**</sup>	4,00 %	01.09.2029	63.554	0,42
10.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc <sup>**</sup>	6,00 %	15.06.2027	9.802	0,07
60.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc <sup>*</sup>	4,13 %	15.08.2026	52.096	0,35
40.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc <sup>**</sup>	5,25 %	15.08.2027	29.973	0,20
250.000	AssuredPartners Inc <sup>**</sup>	5,63 %	15.01.2029	206.085	1,37
105.000	Beacon Roofing Supply Inc <sup>**</sup>	4,13 %	15.05.2029	87.388	0,58
60.000	Berry Global Inc <sup>**</sup>	4,50 %	15.02.2026	57.421	0,38
25.000	BroadStreet Partners Inc <sup>**</sup>	5,88 %	15.04.2029	21.310	0,14
40.000	BroadStreet Partners Inc Series OCT <sup>**</sup>	5,88 %	15.04.2029	34.286	0,23
60.000	Builders FirstSource Inc <sup>**</sup>	5,00 %	01.03.2030	53.273	0,35
20.000	Catalent Pharma Solutions Inc <sup>**</sup>	5,00 %	15.07.2027	18.641	0,12
20.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp <sup>**</sup>	4,50 %	01.05.2032	15.958	0,11
30.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp <sup>**</sup>	5,13 %	01.05.2027	27.901	0,19
55.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp <sup>**</sup>	5,50 %	01.05.2026	53.325	0,35
25.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op <sup>**</sup>	5,50 %	01.05.2025	24.688	0,16
115.000	Centene Corp <sup>**</sup>	4,25 %	15.12.2027	108.108	0,72
60.000	Chart Industries Inc <sup>**</sup>	7,50 %	01.01.2030	60.392	0,40
10.000	Chart Industries Inc <sup>**</sup>	9,50 %	01.01.2031	10.268	0,07
25.000	CHS/Community Health Systems Inc <sup>**</sup>	4,75 %	15.02.2031	18.197	0,12

## Global High Yield Sustainable Action - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 95,99 % (31. Dezember 2021: 95,28 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
65.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,88 %	15.04.2029	33.529	0,22
30.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00 %	15.03.2026	27.375	0,18
45.000	Ciena Corp**	4,00 %	31.01.2030	39.662	0,26
20.000	Clean Harbors Inc**	5,13 %	15.07.2029	18.590	0,12
60.000	Clearway Energy Operating LLC**	3,75 %	15.02.2031	49.906	0,33
85.000	Clearway Energy Operating LLC**	3,75 %	15.01.2032	68.455	0,46
70.000	CommScope Inc**	7,13 %	01.07.2028	50.155	0,33
70.000	Condor Merger Sub Inc**	7,38 %	15.02.2030	56.425	0,38
20.000	Consolidated Communications Inc**	5,00 %	01.10.2028	14.775	0,10
30.000	Consolidated Communications Inc**	6,50 %	01.10.2028	23.387	0,16
165.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13 %	15.01.2029	116.495	0,77
10.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	9.497	0,06
25.000	Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp VI**	4,75 %	01.02.2026	24.312	0,16
230.000	CSC Holdings LLC**	4,63 %	01.12.2030	127.595	0,85
30.000	Dana Inc*	4,50 %	15.02.2032	24.033	0,16
30.000	DaVita Inc**	4,63 %	01.06.2030	24.145	0,16
115.000	Encompass Health Corp*	4,50 %	01.02.2028	104.644	0,70
25.000	Encompass Health Corp*	5,75 %	15.09.2025	24.742	0,16
90.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	5,88 %	15.04.2030	83.968	0,56
15.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	6,13 %	15.04.2032	14.011	0,09
35.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,70 %	10.08.2026	30.438	0,20
30.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,38 %	13.11.2025	27.173	0,18
120.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,66 %	08.09.2024	114.509	0,76
30.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,13 %	17.08.2027	26.919	0,18
30.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,69 %	09.06.2025	28.596	0,19
60.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,13 %	16.06.2025	57.812	0,38
260.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	15.10.2027	242.000	1,61
70.000	Gap Inc**	3,63 %	01.10.2029	49.471	0,33
45.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	31.05.2026	42.521	0,28
25.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,25 %	30.04.2031	20.790	0,14
25.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	9,50 %	31.05.2025	25.728	0,17
20.000	Graphic Packaging International LLC*	4,13 %	15.08.2024	19.680	0,13
210.000	GYP Holdings III Corp**	4,63 %	01.05.2029	172.780	1,15
70.000	HB Fuller Co*	4,00 %	15.02.2027	64.776	0,43
70.000	HB Fuller Co*	4,25 %	15.10.2028	62.189	0,41
185.000	HCA Inc*	5,38 %	01.02.2025	184.926	1,23
30.000	Hologic Inc**	4,63 %	01.02.2028	28.339	0,19
45.000	HUB International Ltd**	7,00 %	01.05.2026	44.146	0,29
165.000	IAA Inc**	5,50 %	15.06.2027	161.217	1,07
70.000	iHeartCommunications Inc**	6,38 %	01.05.2026	64.511	0,43
75.000	IQVIA Inc**	5,00 %	15.10.2026	71.779	0,48
290.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.03.2028	267.261	1,78



## Global High Yield Sustainable Action - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 95,99 % (31. Dezember 2021: 95,28 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
180.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	135.765	0,90
135.000	KAR Auction Services Inc**	5,13 %	01.06.2025	132.096	0,88
80.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	68.453	0,45
205.000	Level 3 Financing Inc**	3,75 %	15.07.2029	147.744	0,98
65.000	Lindblad Expeditions LLC**	6,75 %	15.02.2027	59.047	0,39
55.000	Masonite International Corp**	3,50 %	15.02.2030	44.562	0,30
155.000	Masonite International Corp**	5,38 %	01.02.2028	143.581	0,95
15.000	Mattamy Group Corp**	4,63 %	01.03.2030	12.184	0,08
5.000	Mattamy Group Corp**	5,25 %	15.12.2027	4.443	0,03
65.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,25 %	15.04.2025	60.236	0,40
20.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	16.837	0,11
25.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	20.167	0,13
110.000	Medline Borrower LP**	5,25 %	01.10.2029	87.566	0,58
25.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75 %	01.11.2028	16.680	0,11
125.000	Mueller Water Products Inc**	4,00 %	15.06.2029	110.003	0,73
35.000	Nexstar Media Inc**	4,75 %	01.11.2028	30.328	0,20
175.000	NextEra Energy Operating Partners LP**	4,50 %	15.09.2027	160.472	1,07
45.000	Nokia OYJ*	4,38 %	12.06.2027	42.561	0,28
270.000	OneMain Finance Corp*	3,50 %	15.01.2027	223.889	1,49
35.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	33.702	0,22
25.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	23.828	0,16
200.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV**	5,13 %	30.04.2031	173.427	1,15
170.000	Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**	5,00 %	15.08.2027	153.305	1,02
40.000	Pattern Energy Operations LP/Pattern Energy Operations Inc**	4,50 %	15.08.2028	35.936	0,24
90.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	83.579	0,56
80.000	Prestige Brands Inc**	5,13 %	15.01.2028	75.223	0,50
255.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	232.616	1,55
35.000	Rackspace Technology Global Inc**	3,50 %	15.02.2028	20.383	0,14
85.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	62.119	0,41
135.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75 %	15.01.2029	102.288	0,68
50.000	Resideo Funding Inc**	4,00 %	01.09.2029	40.501	0,27
100.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,50 %	15.02.2029	86.387	0,57
175.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc**	5,38 %	15.01.2025	172.239	1,14
80.000	Sensata Technologies BV**	5,00 %	01.10.2025	78.266	0,52
25.000	Sensata Technologies BV**	5,63 %	01.11.2024	24.882	0,17
50.000	Sirius XM Radio Inc**	3,13 %	01.09.2026	44.459	0,30
40.000	Sprint Capital Corp**	6,88 %	15.11.2028	41.608	0,28
20.000	Sprint Capital Corp**	8,75 %	15.03.2032	23.847	0,16
25.000	SRS Distribution Inc**	6,13 %	01.07.2029	20.246	0,13
35.000	Standard Industries Inc**	4,38 %	15.07.2030	28.595	0,19
90.000	Standard Industries Inc**	5,00 %	15.02.2027	83.180	0,55
70.000	Starwood Property Trust Inc**	3,75 %	31.12.2024	65.812	0,44

## Global High Yield Sustainable Action - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 95,99 % (31. Dezember 2021: 95,28 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
35.000	Starwood Property Trust Inc**	4,38 %	15.01.2027	30.677	0,20
170.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	152.089	1,01
150.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,13 %	01.08.2030	130.201	0,87
55.000	Team Health Holdings Inc**	6,38 %	01.02.2025	31.780	0,21
35.000	Tenet Healthcare Corp*	4,63 %	15.07.2024	34.185	0,23
185.000	Tenet Healthcare Corp**	4,88 %	01.01.2026	176.016	1,17
10.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	8.974	0,06
195.000	TerraForm Power Operating LLC**	5,00 %	31.01.2028	174.821	1,16
70.000	T-Mobile USA Inc**	2,25 %	15.02.2026	63.806	0,42
60.000	Trinseo Materials Operating SCA/Trinseo Materials Finance Inc**	5,38 %	01.09.2025	49.445	0,33
55.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	50.525	0,34
15.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	13.787	0,09
35.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	32.502	0,22
25.000	United Rentals North America Inc*	3,75 %	15.01.2032	20.428	0,14
115.000	United Rentals North America Inc*	4,88 %	15.01.2028	109.233	0,73
65.000	Univar Solutions USA Inc**	5,13 %	01.12.2027	61.755	0,41
40.000	US Foods Inc**	4,75 %	15.02.2029	35.564	0,24
100.000	US Foods Inc**	6,25 %	15.04.2025	99.116	0,66
220.000	Valvoline Inc**	4,25 %	15.02.2030	213.796	1,42
60.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	5,50 %	15.05.2029	53.884	0,36
220.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,75 %	15.07.2031	179.925	1,20
200.000	VZ Secured Financing BV**	5,00 %	15.01.2032	162.886	1,08
65.000	White Capital Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	56.273	0,37
45.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	01.10.2024	44.388	0,30
45.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	36.440	0,24
70.000	Zayo Group Holdings Inc**	6,13 %	01.03.2028	39.846	0,26
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>9.884.966</b>	<b>65,69</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>14.443.671</b>	<b>95,99</b>
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,64 % (31. Dezember 2021: 0,31 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
54.297	Crosby US Acquisition Corp	9,50 %	26.06.2026	52.023	0,35
44.560	Eagle Parent Corp	8,83 %	02.04.2029	43.858	0,29
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>				<b>95.881</b>	<b>0,64</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>14.539.552</b>	<b>96,63</b>

Devisenterminkontrakte 0,05 % (31. Dezember 2021: 0,39 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
880.923 €	775.730 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	7.620	0,05
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞</b>					<b>7.620</b>	<b>0,05</b>

## Global High Yield Sustainable Action - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>14.547.172</b>	<b>96,68</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (2,38 %) (31. Dezember 2021: (0,06 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
4.361.373 US\$	4.416.109 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(356.484)	(2,37)
340.595 US\$	320.257 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(1.545)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(358.029)</b>	<b>(2,38)</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(358.029)</b>	<b>(2,38)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>14.189.143</b>	<b>94,30</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>857.925</b>	<b>5,70</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>15.047.068</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	4.495.913	28,35
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	9.947.758	62,72
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	95.881	0,60
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(350.409)	(2,21)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>14.189.143</b>	<b>89,46</b>

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 94,02 % (31. Dezember 2021: 97,61 %)</b>					
<b>Kanadischer Dollar</b>					
455.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada <sup>†</sup>	2,50 %	14.05.2030	284.090	0,33
195.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada <sup>†</sup>	4,45 %	27.02.2047	122.779	0,14
455.000	Canadian Pacific Railway Co <sup>†</sup>	2,54 %	28.02.2028	301.846	0,35
455.000	Enbridge Inc <sup>†</sup>	4,24 %	27.08.2042	271.487	0,32
410.000	TELUS Corp <sup>†</sup>	2,75 %	08.07.2026	281.404	0,33
325.000	TELUS Corp <sup>†</sup>	4,40 %	01.04.2043	202.094	0,24
620.000	Thomson Reuters Corp <sup>†</sup>	2,24 %	14.05.2025	430.586	0,50
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>				<b>1.894.286</b>	<b>2,21</b>
<b>Euro</b>					
100.000	ABN AMRO Bank NV <sup>*</sup>	0,60 %	15.01.2027	94.183	0,11
477.000	American Tower Corp <sup>*</sup>	0,88 %	21.05.2029	406.829	0,47
150.000	American Tower Corp <sup>*</sup>	0,95 %	05.10.2030	123.241	0,14
103.000	Anglo American Capital Plc <sup>*</sup>	4,75 %	21.09.2032	108.657	0,13
250.000	Anheuser-Busch InBev SA <sup>*</sup>	2,75 %	17.03.2036	233.185	0,27
200.000	Aroundtown SA <sup>*</sup>	1,00 %	07.01.2025	176.619	0,21
300.000	Aroundtown SA <sup>*</sup>	1,45 %	09.07.2028	199.807	0,23
300.000	Aroundtown SA <sup>*</sup>	1,63 %	31.01.2028	211.756	0,25
300.000	AT&T Inc <sup>*</sup>	2,45 %	15.03.2035	261.325	0,30
190.000	Athene Global Funding <sup>*</sup>	0,83 %	08.01.2027	172.738	0,20
1.000.000	Bank of America Corp <sup>*</sup>	1,95 %	27.10.2026	1.002.081	1,17
133.000	Bank of America Corp <sup>*</sup>	2,82 %	27.04.2033	124.095	0,14
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>	3,88 %	16.06.2032	100.377	0,12
289.000	Barclays Plc <sup>*</sup>	0,58 %	09.08.2029	243.731	0,28
124.000	Barclays Plc <sup>*</sup>	2,00 %	07.02.2028	131.453	0,15
100.000	BP Capital Markets Plc <sup>*</sup>	1,10 %	15.11.2034	77.962	0,09
562.000	BP Capital Markets Plc <sup>*</sup>	3,63 %	29.12.2049	516.261	0,60
400.000	BPCE SA <sup>*</sup>	4,00 %	29.11.2032	418.810	0,49
326.000	Comcast Corp <sup>*</sup>	0,75 %	20.02.2032	266.538	0,31
904.000	Credit Suisse Group AG <sup>*</sup>	0,65 %	14.01.2028	722.537	0,84
203.000	Credit Suisse Group AG <sup>*</sup>	7,75 %	01.03.2029	216.266	0,25
136.000	Digital Dutch Finco BV <sup>*</sup>	1,00 %	15.01.2032	102.217	0,12
310.000	Digital Dutch Finco BV <sup>*</sup>	1,25 %	01.02.2031	243.447	0,28
322.000	Discovery Communications LLC <sup>*</sup>	1,90 %	19.03.2027	311.671	0,36
100.000	Duke Energy Corp <sup>*</sup>	3,85 %	15.06.2034	99.277	0,12
100.000	Electricite de France SA <sup>*</sup>	4,75 %	12.10.2034	106.497	0,12
100.000	Elia Transmission Belgium SA <sup>*</sup>	0,88 %	28.04.2030	86.398	0,10
360.000	EnBW International Finance BV <sup>*</sup>	0,13 %	01.03.2028	323.740	0,38
200.000	EnBW International Finance BV <sup>*</sup>	4,05 %	22.11.2029	213.282	0,25
271.000	Enel Finance International NV <sup>*</sup>	0,38 %	28.05.2029	230.736	0,27

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 94,02 % (31. Dezember 2021: 97,61 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
197.638	European Union*	1,00 %	06.07.2032	174.384	0,20
453.000	General Motors Financial Co Inc*	0,85 %	26.02.2026	433.169	0,50
192.000	Goldman Sachs Group Inc*	0,01 %	30.04.2024	202.546	0,24
195.000	Goldman Sachs Group Inc*	1,25 %	07.02.2029	173.696	0,20
100.000	Grand City Properties SA*	0,13 %	11.01.2028	71.864	0,08
118.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,25 %	13.10.2024	111.573	0,13
400.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,38 %	24.07.2028	321.501	0,37
400.000	Infineon Technologies AG*	0,63 %	17.02.2025	401.542	0,47
100.000	ING Groep NV*	4,13 %	24.08.2033	100.532	0,12
100.000	ING Groep NV*	4,88 %	14.11.2027	108.728	0,13
470.000	Liberty Mutual Group Inc*	4,63 %	02.12.2030	480.791	0,56
559.000	Lloyds Banking Group Plc*	0,63 %	15.01.2024	597.024	0,69
130.000	Lloyds Banking Group Plc*	1,75 %	07.09.2028	133.474	0,16
192.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,13 %	24.08.2030	187.820	0,22
100.000	MMS USA Holdings Inc*	1,75 %	13.06.2031	89.094	0,10
120.000	Morgan Stanley*	5,15 %	25.01.2034	133.009	0,15
73.000	Nasdaq Inc*	0,90 %	30.07.2033	55.839	0,07
500.000	National Grid North America Inc*	1,00 %	12.07.2024	512.026	0,60
186.000	National Grid Plc*	2,95 %	30.03.2030	183.023	0,21
483.000	Nationwide Building Society*	2,00 %	25.07.2029	486.216	0,57
197.000	Nationwide Building Society*	3,25 %	05.09.2029	198.548	0,23
349.000	NatWest Group Plc*	0,67 %	14.09.2029	296.415	0,35
121.000	NatWest Group Plc*	1,04 %	14.09.2032	103.525	0,12
309.000	New York Life Global Funding*	0,25 %	04.10.2028	272.462	0,32
100.000	Orange SA*	0,63 %	16.12.2033	76.336	0,09
100.000	Orsted A/S*	5,25 %	08.12.3022	108.315	0,13
150.000	PPG Industries Inc*	2,75 %	01.06.2029	149.449	0,17
1.078.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	903.133	1,05
161.000	SSE Plc*	1,75 %	16.04.2030	147.097	0,17
200.000	Suez SACA*	2,88 %	24.05.2034	181.479	0,21
100.000	Suez SACA*	5,00 %	03.11.2032	109.920	0,13
176.000	Toronto-Dominion Bank*	3,63 %	13.12.2029	181.537	0,21
200.000	UBS Group AG*	0,25 %	24.02.2028	174.527	0,20
552.000	Verizon Communications Inc*	0,75 %	22.03.2032	442.567	0,52
472.000	Verizon Communications Inc*	1,38 %	27.10.2026	462.952	0,54
116.000	Verizon Communications Inc*	4,25 %	31.10.2030	125.740	0,15
700.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88 %	29.12.2049	663.947	0,77
154.000	Westlake Corp*	1,63 %	17.07.2029	133.447	0,16
<b>Euro insgesamt</b>				<b>17.214.963</b>	<b>20,04</b>

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 94,02 % (31. Dezember 2021: 97,61 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britisches Pfund</b>					
275.000	Anheuser-Busch InBev SA*	4,00 %	24.09.2025	325.527	0,38
152.000	Barclays Plc*	8,41 %	14.11.2032	188.885	0,22
123.000	Berkeley Group Plc*	2,50 %	11.08.2031	99.299	0,12
342.000	BP Capital Markets Plc*	4,25 %	29.12.2049	364.297	0,42
378.000	Centrica Plc*	4,38 %	13.03.2029	419.712	0,49
344.000	Credit Suisse Group AG*	2,13 %	15.11.2029	295.067	0,34
90.000	Danske Bank A/S*	2,25 %	14.01.2028	92.710	0,11
179.000	DNB Bank ASA*	4,00 %	17.08.2027	203.783	0,24
214.000	GE Capital UK Funding Unlimited Co*	8,00 %	14.01.2039	295.194	0,34
160.000	Goldman Sachs Group Inc*	3,63 %	29.10.2029	171.817	0,20
240.000	Holcim Sterling Finance Netherlands BV*	2,25 %	04.04.2034	198.260	0,23
200.000	Intesa Sanpaolo SpA**	2,63 %	11.03.2036	154.624	0,18
160.000	Morgan Stanley*	5,79 %	18.11.2033	190.210	0,22
115.000	Nationwide Building Society*	6,18 %	07.12.2027	138.811	0,16
115.000	NatWest Group Plc*	7,42 %	06.06.2033	139.575	0,16
100.000	PepsiCo Inc*	3,55 %	22.07.2034	107.760	0,13
165.000	Phoenix Group Holdings Plc*	5,63 %	28.04.2031	175.939	0,21
113.000	Santander UK Group Holdings Plc*	7,10 %	16.11.2027	138.041	0,16
304.000	Scottish Hydro Electric Transmission Plc*	1,50 %	24.03.2028	304.631	0,35
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>4.004.142</b>	<b>4,66</b>
<b>US-Dollar</b>					
675.000	AbbVie Inc*	4,05 %	21.11.2039	580.586	0,68
220.000	Adventist Health System**	5,43 %	01.03.2032	217.336	0,25
500.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	1,75 %	30.01.2026	440.426	0,51
235.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,00 %	29.10.2028	197.303	0,23
1.000.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	4,50 %	15.09.2023	993.712	1,16
800.000	Air Lease Corp*	0,70 %	15.02.2024	756.016	0,88
245.000	Air Lease Corp*	3,25 %	01.10.2029	209.146	0,24
260.000	American Airlines 2021-1 Class A Pass Through Trust**	2,88 %	11.07.2034	210.005	0,24
265.000	American Express Co*	3,38 %	03.05.2024	259.743	0,30
400.000	American International Group Inc*	4,75 %	01.04.2048	358.775	0,42
400.000	Amgen Inc**	2,80 %	15.08.2041	278.667	0,32
110.000	Amgen Inc**	4,20 %	22.02.2052	87.782	0,10
250.000	Amgen Inc**	4,40 %	01.05.2045	210.619	0,25
475.000	Analog Devices Inc**	2,10 %	01.10.2031	384.788	0,45
900.000	Anglo American Capital Plc*	3,63 %	11.09.2024	871.398	1,01
146.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,60 %	15.04.2048	127.613	0,15
400.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	5,45 %	23.01.2039	400.895	0,47
500.000	Appalachian Power Co**	3,70 %	01.05.2050	366.502	0,43

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 94,02 % (31. Dezember 2021: 97,61 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
400.000	Apple Inc**	2,38 %	08.02.2041	284.304 0,33
500.000	Apple Inc**	3,45 %	09.02.2045	404.311 0,47
570.000	ArcelorMittal SA*	6,55 %	29.11.2027	573.659 0,67
450.000	Ares Capital Corp**	2,88 %	15.06.2028	361.555 0,42
295.000	Arrow Electronics Inc*	2,95 %	15.02.2032	233.341 0,27
315.000	AT&T Inc*	3,50 %	01.06.2041	236.135 0,28
200.000	AT&T Inc*	3,65 %	01.06.2051	141.766 0,17
400.000	AT&T Inc*	4,35 %	01.03.2029	381.231 0,44
1.000.000	Athene Global Funding**	1,61 %	29.06.2026	863.759 1,01
755.000	Baker Hughes Holdings LLC/Baker Hughes Co-Obligor Inc**	2,06 %	15.12.2026	677.735 0,79
215.000	Baltimore Gas & Electric Co**	4,55 %	01.06.2052	191.097 0,22
400.000	Banco Santander SA*	2,75 %	03.12.2030	307.232 0,36
600.000	Banco Santander SA*	4,25 %	11.04.2027	570.520 0,66
775.000	Bank of America Corp**	1,90 %	23.07.2031	596.506 0,69
500.000	Bank of America Corp**	2,59 %	29.04.2031	408.316 0,48
1.000.000	Bank of Montreal**	4,34 %	05.10.2028	980.175 1,14
1.000.000	Barclays Plc*	2,85 %	07.05.2026	930.084 1,08
400.000	Berkshire Hathaway Finance Corp*	4,25 %	15.01.2049	358.318 0,42
800.000	Berry Global Inc**	0,95 %	15.02.2024	758.269 0,88
500.000	BNP Paribas SA**	2,22 %	09.06.2026	459.512 0,54
500.000	Boeing Co*	5,93 %	01.05.2060	458.161 0,53
200.000	Bristol-Myers Squibb Co**	4,35 %	15.11.2047	177.260 0,21
530.000	Broadcom Inc**	4,15 %	15.11.2030	476.257 0,55
900.000	Capital One Financial Corp*	4,20 %	29.10.2025	870.652 1,01
450.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	3,57 %	01.12.2031	371.660 0,43
575.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	419.685 0,49
400.000	Citigroup Inc**	3,35 %	24.04.2025	388.075 0,45
775.000	Citigroup Inc**	3,89 %	10.01.2028	725.316 0,84
400.000	Citigroup Inc**	4,41 %	31.03.2031	368.249 0,43
210.000	CNH Industrial Capital LLC*	5,45 %	14.10.2025	210.685 0,25
200.000	Comcast Corp**	3,40 %	15.07.2046	147.375 0,17
700.000	Comcast Corp**	3,45 %	01.02.2050	510.991 0,60
500.000	Constellation Brands Inc*	3,15 %	01.08.2029	439.238 0,51
435.000	Credit Suisse Group AG**	9,02 %	15.11.2033	446.593 0,52
500.000	CVS Health Corp*	2,70 %	21.08.2040	347.304 0,40
250.000	CVS Health Corp*	5,05 %	25.03.2048	225.659 0,26
800.000	Dell International LLC/EMC Corp**	5,30 %	01.10.2029	784.229 0,91
750.000	Diamondback Energy Inc**	6,25 %	15.03.2033	763.566 0,89
777.000	Dominion Energy Inc*	3,07 %	15.08.2024	749.183 0,87
570.000	Dominion Energy Inc*	5,38 %	15.11.2032	566.764 0,66

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 94,02 % (31. Dezember 2021: 97,61 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
500.000	DTE Energy Co**	2,53 %	01.10.2024	478.269 0,56
250.000	Emerson Electric Co*	2,80 %	21.12.2051	161.985 0,19
500.000	Entergy Corp*	3,75 %	15.06.2050	370.470 0,43
500.000	Enterprise Products Operating LLC*	3,70 %	31.01.2051	362.755 0,42
345.000	EPR Properties**	3,60 %	15.11.2031	250.697 0,29
455.000	EQT Corp*	5,70 %	01.04.2028	453.167 0,53
500.000	Equinix Inc**	2,50 %	15.05.2031	402.971 0,47
235.000	Essential Utilities Inc*	5,30 %	01.05.2052	221.068 0,26
400.000	Exelon Corp**	4,45 %	15.04.2046	339.797 0,40
640.000	F&G Global Funding**	5,15 %	07.07.2025	627.345 0,73
125.000	Fox Corp**	5,48 %	25.01.2039	114.230 0,13
640.000	GE HealthCare Technologies Inc**	5,60 %	15.11.2025	644.628 0,75
310.000	General Motors Co*	5,60 %	15.10.2032	288.872 0,34
500.000	General Motors Financial Co Inc*	4,35 %	09.04.2025	486.844 0,57
500.000	Goldman Sachs Group Inc**	1,99 %	27.01.2032	382.052 0,44
900.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,81 %	23.04.2029	823.696 0,96
440.000	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC*	3,63 %	24.03.2032	387.496 0,45
400.000	Home Depot Inc*	4,25 %	01.04.2046	348.351 0,41
190.000	Home Depot Inc*	4,95 %	15.09.2052	183.531 0,21
1.500.000	HSBC Holdings Plc*	2,01 %	22.09.2028	1.255.997 1,46
345.000	Huntington Bancshares Inc**	5,02 %	17.05.2033	328.640 0,38
250.000	Huntington National Bank**	4,55 %	17.05.2028	241.610 0,28
185.000	Intel Corp**	4,90 %	05.08.2052	164.667 0,19
200.000	Intesa Sanpaolo SpA**	8,25 %	21.11.2033	203.467 0,24
500.000	JPMorgan Chase & Co**	2,30 %	15.10.2025	471.512 0,55
900.000	JPMorgan Chase & Co**	4,01 %	23.04.2029	834.251 0,97
500.000	Kinder Morgan Inc*	5,55 %	01.06.2045	458.246 0,53
280.000	KLA Corp**	4,95 %	15.07.2052	261.676 0,30
900.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,87 %	09.07.2025	871.606 1,01
225.000	Lockheed Martin Corp*	5,70 %	15.11.2054	237.220 0,28
300.000	Lowe's Cos Inc*	3,00 %	15.10.2050	192.128 0,22
200.000	Magellan Midstream Partners LP*	3,95 %	01.03.2050	147.253 0,17
900.000	Marathon Petroleum Corp*	4,70 %	01.05.2025	887.043 1,03
500.000	McDonald's Corp*	3,63 %	01.09.2049	378.536 0,44
400.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC**	5,25 %	29.11.2027	403.323 0,47
400.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC**	5,50 %	27.11.2024	402.820 0,47
85.000	Merck & Co Inc*	2,90 %	10.12.2061	54.451 0,06
275.000	Micron Technology Inc**	2,70 %	15.04.2032	206.298 0,24
280.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	218.333 0,25
400.000	Morgan Stanley**	1,93 %	28.04.2032	302.745 0,35



## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 94,02 % (31. Dezember 2021: 97,61 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
500.000	Morgan Stanley**	2,70 %	22.01.2031	414.247 0,48
685.000	MPLX LP*	4,00 %	15.03.2028	638.349 0,74
1.000.000	NatWest Group Plc*	3,07 %	22.05.2028	895.143 1,04
435.000	Northern Trust Corp**	6,13 %	02.11.2032	460.075 0,54
500.000	Oracle Corp*	2,88 %	25.03.2031	415.792 0,48
200.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.07.2046	146.573 0,17
440.000	Oracle Corp*	6,15 %	09.11.2029	457.746 0,53
230.000	Oracle Corp*	6,90 %	09.11.2052	247.403 0,29
400.000	Paramount Global**	4,20 %	19.05.2032	328.401 0,38
398.000	Paramount Global**	4,75 %	15.05.2025	392.183 0,46
100.000	PepsiCo Inc**	2,63 %	21.10.2041	74.425 0,09
185.000	Phillips 66*	3,30 %	15.03.2052	128.525 0,15
740.000	Piedmont Natural Gas Co Inc**	2,50 %	15.03.2031	605.598 0,71
300.000	Pioneer Natural Resources Co*	1,90 %	15.08.2030	235.610 0,27
360.000	Pioneer Natural Resources Co*	2,15 %	15.01.2031	285.393 0,33
245.000	Prologis LP**	2,25 %	15.01.2032	194.836 0,23
310.000	QUALCOMM Inc**	6,00 %	20.05.2053	331.213 0,39
500.000	Societe Generale SA**	3,63 %	01.03.2041	326.082 0,38
155.000	Southern California Edison Co*	4,88 %	01.03.2049	137.091 0,16
200.000	Starbucks Corp**	4,50 %	15.11.2048	172.495 0,20
360.000	SVB Financial Group**	4,35 %	29.04.2028	340.978 0,40
250.000	Synchrony Bank*	5,40 %	22.08.2025	245.610 0,29
340.000	Synchrony Financial*	2,88 %	28.10.2031	254.673 0,30
100.000	Sysco Corp*	6,60 %	01.04.2050	109.587 0,13
225.000	Tapestry Inc*	3,05 %	15.03.2032	175.680 0,20
400.000	Telefonica Emisiones SA*	5,21 %	08.03.2047	322.864 0,38
500.000	T-Mobile USA Inc*	3,75 %	15.04.2027	471.710 0,55
140.000	T-Mobile USA Inc*	4,50 %	15.04.2050	115.792 0,14
260.000	T-Mobile USA Inc**	5,80 %	15.09.2062	253.134 0,29
545.000	Toll Brothers Finance Corp*	3,80 %	01.11.2029	466.417 0,54
200.000	Tucson Electric Power Co*	3,25 %	01.05.2051	132.587 0,15
800.000	UBS Group AG**	1,01 %	30.07.2024	778.058 0,91
380.000	Union Pacific Corp*	3,20 %	20.05.2041	299.764 0,35
1.422.690	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88 %	15.10.2027	1.404.663 1,64
190.000	UnitedHealth Group Inc*	6,05 %	15.02.2063	207.543 0,24
650.000	Verizon Communications Inc*	2,85 %	03.09.2041	449.808 0,52
400.000	Vodafone Group Plc**	4,38 %	19.02.2043	321.875 0,37
1.000.000	Vontier Corp**	1,80 %	01.04.2026	847.119 0,99
175.000	Walmart Inc*	2,65 %	22.09.2051	119.199 0,14
500.000	Walt Disney Co*	3,60 %	13.01.2051	383.248 0,45

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 94,02 % (31. Dezember 2021: 97,61 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
95.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,05 %	15.03.2042	73.019	0,09
185.000	Westlake Corp*	3,38 %	15.08.2061	109.845	0,13
1.000.000	Westpac Banking Corp**	2,89 %	04.02.2030	917.534	1,07
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>57.653.972</b>	<b>67,11</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>80.767.363</b>	<b>94,02</b>
<b>Staatsanleihen 3,21 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
2.865.000	United States Treasury Note/Bond	2,63 %	15.04.2025	2.758.010	3,21
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>2.758.010</b>	<b>3,21</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>83.525.373</b>	<b>97,23</b>

Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2021: 0,47 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
408.443 €	433.639 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	2.713	0,00
225.146 €	236.766 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	3.763	0,00
100.544 £	111.344 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	9.648	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>16.124</b>	<b>0,01</b>

				Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>				<b>83.541.497</b>	<b>97,24</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,91 %) (31. Dezember 2021: (0,01 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
608.022 US\$	826.471 CAD	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.985)	(0,00)
18.294.619 US\$	18.388.969 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(1.350.854)	(1,57)
1.323.180 US\$	1.813.548 CAD	18.01.2023	UBS AG	1	(15.374)	(0,02)
3.937.974 US\$	3.500.633 £	18.01.2023	UBS AG	1	(274.606)	(0,32)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(1.642.819)</b>	<b>(1,91)</b>

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.642.819)</b>	<b>(1,91)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>81.898.678</b>	<b>95,33</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>4.009.964</b>	<b>4,67</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>85.908.642</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>		
	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	52.237.434	59,37
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	29.595.747	33,64
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	1.692.192	1,92
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(1.626.695)	(1,85)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>81.898.678</b>	<b>93,08</b>

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Agency Bonds 0,40 % (31. Dezember 2021: 0,43 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
280.000	Federal Home Loan Banks	5,50 %	15.07.2036	307.820	0,40
<b>Agency Bonds insgesamt *</b>				<b>307.820</b>	<b>0,40</b>
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 5,64 % (31. Dezember 2021: 11,47 %)</b>					
<b>Euro</b>					
155.078	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	4,89 %	24.02.2058	157.257	0,21
270.874	FTA Santander Consumo 4 Class C	2,20 %	18.09.2032	272.428	0,36
174.557	Futura S.r.l. 2019-1 Class A	3,63 %	31.07.2044	186.670	0,24
<b>Euro insgesamt</b>				<b>616.355</b>	<b>0,81</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
76.929	Towd Point Mortgage Funding 2018 - Auburn 12 Plc Class A	4,19 %	20.02.2045	91.718	0,12
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>91.718</b>	<b>0,12</b>
<b>US-Dollar</b>					
288.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1	8,64 %	25.01.2031	297.932	0,39
354.492	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	6,74 %	25.01.2031	355.617	0,47
331.779	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	7,04 %	25.02.2030	334.138	0,44
338.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2B1	9,89 %	25.09.2029	365.180	0,48
161.821	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	6,59 %	25.08.2030	159.938	0,21
539.789	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	6,19 %	25.07.2030	526.714	0,69
825.687	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	6,69 %	25.09.2030	829.305	1,09
171.842	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	6,74 %	25.04.2030	172.593	0,23
525.422	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	7,64 %	25.07.2029	540.612	0,71
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>3.582.029</b>	<b>4,71</b>
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>4.290.102</b>	<b>5,64</b>
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %)</b>					
<b>Euro</b>					
200.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	184.307	0,24
100.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	92.033	0,12
135.000	Adevinta ASA*	2,63 %	15.11.2025	134.392	0,18
200.000	Adient Global Holdings Ltd*	3,50 %	15.08.2024	205.305	0,27
255.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	231.881	0,30
150.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	145.483	0,19
117.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	101.731	0,13
100.000	Altice Finco SA*	4,75 %	15.01.2028	79.844	0,10
147.000	Altice France Holding SA*	4,00 %	15.02.2028	102.009	0,13
100.000	Altice France SA*	2,50 %	15.01.2025	96.235	0,13
140.000	Altice France SA*	3,38 %	15.01.2028	113.511	0,15

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
200.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	164.035	0,22
200.000	American Tower Corp*	0,88 %	21.05.2029	170.578	0,22
150.000	Anheuser-Busch InBev SA*	2,00 %	23.01.2035	130.778	0,17
130.000	Anheuser-Busch InBev SA*	2,75 %	17.03.2036	121.256	0,16
120.000	Apple Inc*	0,50 %	15.11.2031	102.470	0,13
220.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	225.827	0,30
150.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	3,00 %	01.09.2029	118.036	0,16
150.000	Arena Luxembourg Finance Sarl*	1,88 %	01.02.2028	128.712	0,17
139.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	127.349	0,17
100.000	Assemblin Financing AB**	7,05 %	15.05.2025	104.758	0,14
199.000	Autostrade per l'Italia SpA*	1,88 %	26.09.2029	169.537	0,22
200.000	Avantor Funding Inc*	3,88 %	15.07.2028	198.503	0,26
100.000	Banjay Entertainment SASU**	3,50 %	01.03.2025	100.762	0,13
107.000	Banjay Group SAS**	6,50 %	01.03.2026	108.134	0,14
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	1,25 %	03.06.2030	261.142	0,34
270.000	Barclays Plc*	0,58 %	09.08.2029	227.707	0,30
100.000	Bayer AG*	2,38 %	12.11.2079	96.082	0,13
100.000	Bayer AG*	5,38 %	25.03.2082	93.873	0,12
100.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	89.906	0,12
178.000	BCP V Modular Services Finance Plc**	6,75 %	30.11.2029	141.654	0,19
100.000	Belden Inc*	3,38 %	15.07.2027	98.195	0,13
100.000	Belden Inc*	3,88 %	15.03.2028	97.743	0,13
100.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25 %	30.04.2029	92.940	0,12
171.000	Booking Holdings Inc*	0,50 %	08.03.2028	153.952	0,20
100.000	Canpack SA/Canpack US LLC*	2,38 %	01.11.2027	84.472	0,11
100.000	Castle UK Finco Plc**	7,01 %	15.05.2028	79.568	0,10
100.000	Castor SpA*	7,30 %	15.02.2029	103.804	0,14
100.000	Celanese US Holdings LLC*	4,78 %	19.07.2026	101.831	0,13
200.000	Cellnex Finance Co SA*	1,50 %	08.06.2028	178.416	0,23
100.000	Cellnex Telecom SA*	1,75 %	23.10.2030	83.357	0,11
150.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH**	4,38 %	15.01.2028	141.515	0,19
100.000	Chrome Holdco SASU*	5,00 %	31.05.2029	83.299	0,11
100.000	Cirsa Finance International Sarl*	10,38 %	30.11.2027	109.630	0,14
125.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38 %	15.05.2026	123.335	0,16
200.000	CMA CGM SA*	7,50 %	15.01.2026	221.339	0,29
100.000	Constellium SE*	4,25 %	15.02.2026	103.171	0,14
100.000	Coty Inc**	4,75 %	15.04.2026	100.588	0,13
137.000	Credit Suisse Group AG*	0,65 %	14.01.2028	109.499	0,14
200.000	Ctec II GmbH**	5,25 %	15.02.2030	179.097	0,24
100.000	Cullinan Holdco Scsp**	4,63 %	15.10.2026	93.841	0,12

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
100.000	Deutsche Lufthansa AG <sup>*</sup>	3,00 %	29.05.2026	96.645	0,13
200.000	Digital Intrepid Holding BV <sup>*</sup>	0,63 %	15.07.2031	147.267	0,19
200.000	DKT Finance ApS <sup>**</sup>	7,00 %	17.06.2023	212.643	0,28
100.000	Douglas GmbH <sup>*</sup>	6,00 %	08.04.2026	89.880	0,12
100.000	Dufry One BV <sup>**</sup>	2,00 %	15.02.2027	87.776	0,12
100.000	Dufry One BV <sup>*</sup>	3,38 %	15.04.2028	89.008	0,12
100.000	eG Global Finance Plc <sup>*</sup>	3,63 %	07.02.2024	101.537	0,13
100.000	eG Global Finance Plc <sup>*</sup>	4,38 %	07.02.2025	93.079	0,12
175.000	eircom Finance DAC <sup>**</sup>	1,75 %	01.11.2024	180.202	0,24
100.000	Electricite de France SA <sup>*</sup>	5,00 %	29.12.2049	97.747	0,13
400.000	Electricite de France SA <sup>*</sup>	7,50 %	29.12.2049	426.458	0,56
270.000	EnBW International Finance BV <sup>*</sup>	0,13 %	01.03.2028	242.805	0,32
320.000	Encore Capital Group Inc <sup>*</sup>	5,63 %	15.01.2028	323.249	0,42
150.000	Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC <sup>**</sup>	4,00 %	15.09.2025	157.185	0,21
83.000	European Union <sup>*</sup>	0,00 %	06.07.2026	79.922	0,11
37.000	European Union <sup>*</sup>	1,25 %	04.02.2043	27.825	0,04
40.000	European Union <sup>*</sup>	1,63 %	04.12.2029	38.930	0,05
68.000	European Union <sup>*</sup>	2,00 %	04.10.2027	69.316	0,09
32.000	European Union <sup>*</sup>	2,75 %	04.12.2037	31.794	0,04
18.000	European Union <sup>*</sup>	3,00 %	04.03.2053	18.603	0,02
100.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	2,38 %	15.06.2027	89.459	0,12
100.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	2,63 %	15.06.2025	97.448	0,13
162.000	Faurecia SE <sup>*</sup>	2,75 %	15.02.2027	146.455	0,19
100.000	Fiber Bidco SpA <sup>*</sup>	11,00 %	25.10.2027	113.577	0,15
100.000	Fidelity National Information Services Inc <sup>*</sup>	2,00 %	21.05.2030	91.684	0,12
100.000	Fiserv Inc <sup>*</sup>	1,63 %	01.07.2030	88.744	0,12
155.000	Food Service Project SA <sup>*</sup>	5,50 %	21.01.2027	153.934	0,20
200.000	Gruenenthal GmbH <sup>**</sup>	4,13 %	15.05.2028	193.071	0,25
335.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV <sup>*</sup>	1,75 %	29.03.2030	310.693	0,41
200.000	Guala Closures SpA <sup>*</sup>	3,25 %	15.06.2028	183.750	0,24
150.000	Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>	3,25 %	29.12.2049	117.671	0,15
100.000	Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>	1,38 %	24.07.2028	80.375	0,11
100.000	Huhtamaki OYJ <sup>*</sup>	4,25 %	09.06.2027	104.734	0,14
200.000	IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>	3,88 %	15.05.2027	181.164	0,24
200.000	Iliad Holding SASU <sup>**</sup>	5,13 %	15.10.2026	198.556	0,26
113.000	Iliad Holding SASU <sup>**</sup>	5,63 %	15.10.2028	110.020	0,14
100.000	iliad SA <sup>*</sup>	5,38 %	14.06.2027	106.425	0,14
175.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA <sup>*</sup>	3,75 %	15.01.2028	154.887	0,20
300.000	INEOS Finance Plc <sup>*</sup>	3,38 %	31.03.2026	286.577	0,38
300.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc <sup>*</sup>	3,75 %	15.07.2026	264.950	0,35

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
100.000	Infineon Technologies AG <sup>*</sup>	1,63 %	24.06.2029	92.932	0,12
100.000	Infineon Technologies AG <sup>*</sup>	3,63 %	29.12.2049	95.756	0,13
100.000	International Consolidated Airlines Group SA <sup>*</sup>	3,75 %	25.03.2029	81.783	0,11
150.000	International Game Technology Plc <sup>*</sup>	3,50 %	15.06.2026	153.251	0,20
100.000	Intrum AB <sup>*</sup>	3,00 %	15.09.2027	85.784	0,11
52.111	Intrum AB <sup>*</sup>	3,13 %	15.07.2024	53.783	0,07
100.000	Intrum AB <sup>*</sup>	3,50 %	15.07.2026	90.144	0,12
222.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc <sup>*</sup>	4,50 %	15.01.2026	204.657	0,27
100.000	JPMorgan Chase & Co <sup>*</sup>	0,39 %	24.02.2028	91.446	0,12
100.000	JPMorgan Chase & Co <sup>*</sup>	1,81 %	12.06.2029	94.184	0,12
100.000	Kapla Holding SAS <sup>*</sup>	3,38 %	15.12.2026	95.223	0,13
59.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>	0,00 %	15.06.2026	56.888	0,07
21.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>	0,00 %	15.09.2031	17.162	0,02
27.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>	0,01 %	05.05.2027	25.376	0,03
18.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>**</sup>	0,38 %	09.03.2026	17.757	0,02
47.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>**</sup>	0,75 %	28.06.2028	44.527	0,06
32.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>	0,75 %	15.01.2029	29.893	0,04
46.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>	1,25 %	30.06.2027	45.469	0,06
165.000	Kronos International Inc <sup>**</sup>	3,75 %	15.09.2025	154.804	0,20
150.000	Laboratoire Eimer Selas <sup>**</sup>	5,00 %	01.02.2029	122.893	0,16
200.000	LeasePlan Corp NV <sup>*</sup>	7,38 %	29.12.2049	211.928	0,28
100.000	LHMC Finco 2 Sarl <sup>*</sup>	7,25 %	02.10.2025	92.602	0,12
100.000	Lincoln Financing Sarl <sup>**</sup>	6,01 %	01.04.2024	106.421	0,14
370.000	Lorca Telecom Bondco SA <sup>*</sup>	4,00 %	18.09.2027	354.772	0,47
191.000	Loxam SAS <sup>*</sup>	5,75 %	15.07.2027	175.109	0,23
104.311	Loxam SAS <sup>*</sup>	6,00 %	15.04.2025	105.046	0,14
100.000	Matterhorn Telecom SA <sup>**</sup>	3,13 %	15.09.2026	97.120	0,13
100.000	Matterhorn Telecom SA <sup>**</sup>	4,00 %	15.11.2027	98.016	0,13
100.000	Maxeda DIY Holding BV <sup>**</sup>	5,88 %	01.10.2026	74.919	0,10
100.000	Medtronic Global Holdings SCA <sup>*</sup>	1,38 %	15.10.2040	70.064	0,09
150.000	Molson Coors Beverage Co <sup>*</sup>	1,25 %	15.07.2024	154.698	0,20
100.000	Mooney Group SpA <sup>**</sup>	5,94 %	17.12.2026	101.749	0,13
100.000	Morgan Stanley <sup>*</sup>	0,50 %	26.10.2029	85.644	0,11
100.000	Motion Finco Sarl <sup>**</sup>	7,00 %	15.05.2025	106.813	0,14
100.000	Nationwide Building Society <sup>*</sup>	2,00 %	25.07.2029	100.666	0,13
178.000	NH Hotel Group SA <sup>*</sup>	4,00 %	02.07.2026	175.267	0,23
150.000	Nidda Healthcare Holding GmbH <sup>**</sup>	7,50 %	21.08.2026	153.599	0,20
100.000	Olympus Water US Holding Corp <sup>*</sup>	3,88 %	01.10.2028	87.059	0,11
100.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV <sup>*</sup>	2,88 %	30.04.2028	94.003	0,12
100.000	Paganini Bidco SpA <sup>*</sup>	5,89 %	30.10.2028	103.310	0,14

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
100.000	Paprec Holding SA**	3,50 %	01.07.2028	92.927	0,12
402.000	Petroleos Mexicanos*	4,75 %	26.02.2029	336.811	0,44
104.000	Playtech Plc*	4,25 %	07.03.2026	105.225	0,14
100.000	PrestigeBidCo GmbH**	7,38 %	15.07.2027	99.620	0,13
100.000	RCS & RDS SA*	2,50 %	05.02.2025	97.331	0,13
210.000	Repsol International Finance BV*	4,25 %	29.12.2049	200.590	0,26
160.000	Rossini Sarl*	5,48 %	30.10.2025	168.732	0,22
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	1,00 %	12.08.2027	74.771	0,10
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,62 %	29.12.2049	42.218	0,06
100.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63 %	15.03.2028	92.350	0,12
200.000	Schaeffler AG*	3,38 %	12.10.2028	186.868	0,25
100.000	SES SA*	5,63 %	29.12.2049	104.316	0,14
200.000	SGL Carbon SE*	4,63 %	30.09.2024	212.577	0,28
100.000	Sherwood Financing Plc**	6,39 %	15.11.2027	97.387	0,13
100.000	SoftBank Group Corp*	5,00 %	15.04.2028	91.398	0,12
100.000	SPCM SA*	2,63 %	01.02.2029	90.045	0,12
180.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75 %	31.10.2026	164.640	0,22
200.000	Summit Properties Ltd*	2,00 %	31.01.2025	184.726	0,24
130.000	TeamSystem SpA*	3,50 %	15.02.2028	116.840	0,15
87.920	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	88.595	0,12
300.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	295.363	0,39
100.000	Telecom Italia SpA*	2,38 %	12.10.2027	90.230	0,12
100.000	Telecom Italia SpA*	2,88 %	28.01.2026	97.583	0,13
100.000	Telefonica Europe BV*	2,88 %	29.12.2049	89.537	0,12
200.000	Telefonica Europe BV*	3,88 %	29.12.2049	194.069	0,26
100.000	Tendam Brands SAU*	8,97 %	31.03.2028	103.758	0,14
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale*	2,38 %	29.12.2049	89.653	0,12
150.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63 %	15.10.2028	119.684	0,16
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	4,38 %	09.05.2030	89.022	0,12
199.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	6,00 %	31.01.2025	209.922	0,28
120.000	thyssenkrupp AG*	2,88 %	22.02.2024	126.759	0,17
100.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75 %	15.04.2029	79.553	0,10
100.000	Titan Holdings II BV*	5,13 %	15.07.2029	85.090	0,11
92.700	TK Elevator Holdco GmbH**	6,63 %	15.07.2028	82.415	0,11
100.000	TK Elevator Midco GmbH**	6,13 %	15.07.2027	103.723	0,14
205.000	Toronto-Dominion Bank*	3,13 %	03.08.2032	200.822	0,26
115.000	Trivium Packaging Finance BV*	3,75 %	15.08.2026	112.608	0,15
150.000	UGI International LLC**	2,50 %	01.12.2029	123.766	0,16
100.000	United Group BV**	4,88 %	01.07.2024	99.727	0,13
100.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	77.529	0,10



## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
270.000	Utah Acquisition Sub Inc*	3,13 %	22.11.2028	265.051	0,35
200.000	Veolia Environnement SA*	2,50 %	29.12.2049	170.754	0,22
300.000	Verisure Holding AB*	3,25 %	15.02.2027	279.037	0,37
100.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	86.175	0,11
370.000	Verizon Communications Inc*	1,88 %	26.10.2029	346.659	0,46
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,50 %	01.11.2025	80.338	0,11
300.000	Vonovia SE*	0,25 %	01.09.2028	245.850	0,32
100.000	Vonovia SE*	1,00 %	16.06.2033	71.352	0,09
137.000	WEPA Hygieneprodukte GmbH**	2,88 %	15.12.2027	120.078	0,16
100.000	Westlake Corp*	1,63 %	17.07.2029	86.654	0,11
300.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	245.474	0,32
100.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	90.213	0,12
260.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	202.185	0,27
<b>Euro insgesamt</b>				<b>24.004.584</b>	<b>31,54</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
235.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	227.166	0,30
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	83.355	0,11
195.000	Bellis Finco Plc†	4,00 %	16.02.2027	173.262	0,23
100.000	Centrica Plc*	5,25 %	10.04.2075	110.611	0,14
112.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	124.243	0,16
100.000	Credit Suisse Group AG*	2,13 %	15.11.2029	85.775	0,11
300.000	Danske Bank*	2,25 %	14.01.2028	309.035	0,41
160.000	Lloyds Banking Group Plc*	2,71 %	03.12.2035	143.129	0,19
107.000	Maison Finco Plc**	6,00 %	31.10.2027	94.318	0,12
110.000	Marks & Spencer Plc*	3,75 %	19.05.2026	115.647	0,15
120.000	National Express Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	119.542	0,16
500.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	570.415	0,75
100.000	Pinewood Finance Co Ltd**	3,25 %	30.09.2025	111.130	0,15
144.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38 %	15.02.2025	150.926	0,20
100.000	Premier Foods Finance Plc*	3,50 %	15.10.2026	105.968	0,14
100.000	RAC Bond Co Plc**	5,25 %	04.11.2027	95.403	0,12
100.000	Travis Perkins Plc*	3,75 %	17.02.2026	106.757	0,14
150.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	4,25 %	15.01.2030	140.949	0,18
200.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	195.193	0,26
100.000	Vodafone Group Plc*	5,90 %	26.11.2032	127.018	0,17
300.000	Volkswagen Financial Services NV*	4,25 %	09.10.2025	346.510	0,45
102.000	Voyage Care BondCo Plc**	5,88 %	15.02.2027	103.985	0,14
172.000	Westfield America Management Ltd*	2,63 %	30.03.2029	159.154	0,21
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>3.799.491</b>	<b>4,99</b>

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
20.000	AbbVie Inc <sup>*</sup>	4,88 %	14.11.2048	18.325	0,02
200.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC <sup>*</sup>	4,60 %	02.11.2047	184.382	0,24
170.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup>	1,75 %	30.01.2026	149.745	0,20
70.000	Air Lease Corp <sup>*</sup>	0,70 %	15.02.2024	66.151	0,09
90.000	Air Lease Corp <sup>*</sup>	2,30 %	01.02.2025	83.863	0,11
45.000	Apple Inc <sup>**</sup>	4,65 %	23.02.2046	42.849	0,06
125.000	Ares Capital Corp <sup>**</sup>	2,88 %	15.06.2028	100.432	0,13
205.000	AT&T Inc <sup>*</sup>	3,65 %	01.06.2051	145.310	0,19
60.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	2,50 %	13.02.2031	48.896	0,06
275.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	2,97 %	04.02.2033	222.255	0,29
110.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	3,71 %	24.04.2028	101.959	0,13
90.000	Bank of America Corp <sup>**</sup>	5,02 %	22.07.2033	85.711	0,11
145.000	Barclays Plc <sup>*</sup>	2,85 %	07.05.2026	134.862	0,18
165.000	Boeing Co <sup>*</sup>	5,81 %	01.05.2050	153.825	0,20
120.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais <sup>†</sup>	5,33 %	15.02.2028	117.293	0,15
60.000	Capital One Financial Corp <sup>*</sup>	3,20 %	30.01.2023	60.000	0,08
130.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital <sup>**</sup>	4,80 %	01.03.2050	94.885	0,12
15.000	Cigna Corp <sup>*</sup>	3,20 %	15.03.2040	11.375	0,02
70.000	Citigroup Inc <sup>**</sup>	2,98 %	05.11.2030	59.005	0,08
95.000	Citigroup Inc <sup>**</sup>	3,35 %	24.04.2025	92.168	0,12
105.000	Citigroup Inc <sup>**</sup>	3,52 %	27.10.2028	95.975	0,13
125.000	Citigroup Inc <sup>**</sup>	3,79 %	17.03.2033	107.247	0,14
165.000	Comcast Corp <sup>**</sup>	2,94 %	01.11.2056	102.793	0,14
35.000	Corebridge Financial Inc <sup>**</sup>	4,35 %	05.04.2042	29.029	0,04
55.000	Crown Castle Inc <sup>*</sup>	1,05 %	15.07.2026	47.587	0,06
30.000	CVS Health Corp <sup>*</sup>	4,13 %	01.04.2040	25.083	0,03
135.000	CVS Health Corp <sup>*</sup>	5,05 %	25.03.2048	121.856	0,16
175.000	Dell International LLC/EMC Corp <sup>**</sup>	5,30 %	01.10.2029	171.550	0,23
80.000	Discovery Communications LLC <sup>**</sup>	3,63 %	15.05.2030	66.099	0,09
84.000	DTE Energy Co <sup>*</sup>	3,40 %	15.06.2029	74.815	0,10
55.000	Duke Energy Corp <sup>*</sup>	2,55 %	15.06.2031	44.952	0,06
200.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado <sup>*</sup>	3,83 %	14.09.2061	138.183	0,18
140.000	EPR Properties <sup>**</sup>	3,60 %	15.11.2031	101.732	0,13
90.000	Exxon Mobil Corp <sup>*</sup>	3,45 %	15.04.2051	68.215	0,09
100.000	Fox Corp <sup>**</sup>	5,58 %	25.01.2049	89.702	0,12
70.000	General Motors Co <sup>*</sup>	6,13 %	01.10.2025	71.312	0,09
150.000	General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>	3,60 %	21.06.2030	126.568	0,17
130.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	2,62 %	22.04.2032	103.986	0,14
115.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	3,27 %	29.09.2025	110.894	0,15
85.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	3,69 %	05.06.2028	79.108	0,10

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
105.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,81 %	23.04.2029	96.098	0,13
95.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,02 %	31.10.2038	78.452	0,10
80.000	HCA Inc*	5,25 %	15.06.2049	68.513	0,09
60.000	JPMorgan Chase & Co**	2,96 %	13.05.2031	49.569	0,07
50.000	JPMorgan Chase & Co**	3,11 %	22.04.2041	36.525	0,05
200.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38 %	24.04.2030	180.088	0,24
130.000	Kinder Morgan Inc*	5,55 %	01.06.2045	119.144	0,16
80.000	Lennar Corp*	4,75 %	29.11.2027	77.260	0,10
240.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,51 %	18.03.2026	228.206	0,30
55.000	Marathon Petroleum Corp*	4,70 %	01.05.2025	54.208	0,07
100.000	Micron Technology Inc**	2,70 %	15.04.2032	75.017	0,10
100.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	77.976	0,10
105.000	Morgan Stanley**	0,79 %	22.01.2025	99.377	0,13
135.000	Morgan Stanley**	2,70 %	22.01.2031	111.847	0,15
60.000	Morgan Stanley*	3,63 %	20.01.2027	56.668	0,07
60.000	MPLX LP*	4,70 %	15.04.2048	47.612	0,06
55.000	Mylan Inc**	4,55 %	15.04.2028	50.977	0,07
95.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.07.2046	69.622	0,09
95.000	Paramount Global**	4,95 %	15.01.2031	84.655	0,11
90.000	Paramount Global**	6,38 %	30.03.2062	73.708	0,10
1.360.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,38 %	12.04.2027	66.300	0,09
200.000	Petroleos del Peru SA*	5,63 %	19.06.2047	131.165	0,17
133.000	Petroleos Mexicanos*	5,95 %	28.01.2031	100.965	0,13
115.000	Petroleos Mexicanos*	6,75 %	21.09.2047	73.633	0,10
21.000	Petroleos Mexicanos**	6,84 %	23.01.2030	17.404	0,02
179.000	Petroleos Mexicanos*	7,69 %	23.01.2050	124.259	0,16
95.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	3,55 %	15.12.2029	82.577	0,11
80.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	4,65 %	15.10.2025	78.366	0,10
55.000	Rogers Communications Inc**	3,80 %	15.03.2032	47.612	0,06
100.000	Rogers Communications Inc**	4,55 %	15.03.2052	77.992	0,10
380.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88 %	24.03.2026	391.382	0,51
115.000	Synchrony Financial*	2,88 %	28.10.2031	86.139	0,11
83.000	Sysco Corp*	6,60 %	01.04.2050	90.957	0,12
95.000	T-Mobile USA Inc*	4,50 %	15.04.2050	78.573	0,10
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	136.114	0,18
350.000	Verizon Communications Inc*	2,55 %	21.03.2031	288.690	0,38
175.000	Viatis Inc**	3,85 %	22.06.2040	117.891	0,16
45.000	Vodafone Group Plc**	5,25 %	30.05.2048	39.852	0,05
90.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,14 %	15.03.2052	65.774	0,09

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 46,55 % (31. Dezember 2021: 46,32 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
75.000	Westlake Corp*	3,13 %	15.08.2051	46.480	0,06
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>7.627.624</b>	<b>10,02</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>35.431.699</b>	<b>46,55</b>
<b>Staatsanleihen 32,47 % (31. Dezember 2021: 27,03 %)</b>					
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>					
5.490.000	China Government Bond**	2,26 %	24.02.2025	787.871	1,03
4.570.000	China Government Bond**	2,37 %	20.01.2027	651.903	0,86
10.180.000	China Government Bond**	2,56 %	21.10.2023	1.468.730	1,93
1.560.000	China Government Bond**	3,02 %	27.05.2031	227.594	0,30
2.470.000	China Government Bond**	3,53 %	18.10.2051	373.328	0,49
440.000	China Government Bond**	4,05 %	24.07.2047	71.818	0,09
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>				<b>3.581.244</b>	<b>4,70</b>
<b>Tschechische Krone</b>					
12.470.000	Czech Republic Government Bond*	0,95 %	15.05.2030	413.371	0,54
<b>Tschechische Krone insgesamt</b>				<b>413.371</b>	<b>0,54</b>
<b>Euro</b>					
100.000	Andorra International Bond*	1,25 %	23.02.2027	95.947	0,13
28.767	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2030	25.515	0,03
214.595	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.02.2031	187.118	0,25
40.582	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2031	35.020	0,05
31.500	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2052	16.533	0,02
162.529	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,50 %	15.02.2026	163.166	0,21
30.300	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,50 %	15.02.2028	29.339	0,04
186.715	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	1,70 %	15.08.2032	185.664	0,24
100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale*	1,50 %	25.05.2032	91.081	0,12
12.483	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,10 %	15.04.2023	13.211	0,02
240.000	Egypt Government International Bond*	6,38 %	11.04.2031	178.779	0,24
17.000	Estonia Government International Bond*	4,00 %	12.10.2032	18.663	0,02
110.220	French Republic Government Bond OAT**	0,25 %	25.07.2024	118.556	0,16
20.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.02.2028	19.242	0,03
7.341	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2052	4.154	0,01
266.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2053	148.601	0,20
88.920	French Republic Government Bond OAT*	1,25 %	25.05.2038	71.906	0,09
43.355	French Republic Government Bond OAT*	1,50 %	25.05.2031	41.625	0,05
12.000	French Republic Government Bond OAT*	1,75 %	25.05.2066	8.803	0,01
354.540	French Republic Government Bond OAT**	2,10 %	25.07.2023	387.600	0,51
4.000	Hungary Government International Bond*	1,75 %	05.06.2035	2.819	0,00

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 32,47 % (31. Dezember 2021: 27,03 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
200.000	Indonesia Government International Bond <sup>†</sup>	1,40 %	30.10.2031	167.276	0,22
200.000	Indonesia Government International Bond <sup>†</sup>	3,75 %	14.06.2028	208.364	0,27
21.000	Ireland Government Bond <sup>**</sup>	0,20 %	18.10.2030	18.232	0,02
35.000	Ireland Government Bond <sup>†</sup>	0,55 %	22.04.2041	23.485	0,03
23.000	Ireland Government Bond <sup>†</sup>	2,40 %	15.05.2030	23.770	0,03
18.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	0,00 %	01.08.2026	16.847	0,02
32.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	0,50 %	15.07.2028	28.216	0,04
263.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>†</sup>	0,90 %	01.04.2031	213.926	0,28
64.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>†</sup>	0,95 %	15.09.2027	60.000	0,08
20.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	0,95 %	01.06.2032	15.634	0,02
31.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	1,20 %	15.08.2025	31.167	0,04
133.263	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	1,40 %	26.05.2025	140.652	0,18
39.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	1,60 %	01.06.2026	38.899	0,05
299.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	1,75 %	30.05.2024	312.423	0,41
11.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>†</sup>	1,85 %	01.07.2025	11.282	0,01
19.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	2,05 %	01.08.2027	18.808	0,02
46.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	2,50 %	01.12.2032	41.061	0,05
130.000	Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>	5,25 %	22.03.2030	117.565	0,15
310.000	Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>	5,88 %	17.10.2031	279.219	0,37
100.000	Kazakhstan Government International Bond <sup>†</sup>	2,38 %	09.11.2028	96.615	0,13
23.128	Kingdom of Belgium Government Bond <sup>†</sup>	0,40 %	22.06.2040	15.100	0,02
18.000	Kingdom of Belgium Government Bond <sup>†</sup>	3,75 %	22.06.2045	20.438	0,03
23.000	Lithuania Government International Bond <sup>†</sup>	2,13 %	01.06.2032	21.439	0,03
150.000	Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>	1,95 %	17.11.2036	110.820	0,15
100.000	Philippine Government International Bond <sup>†</sup>	1,75 %	28.04.2041	73.672	0,10
615.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT <sup>†</sup>	1,65 %	16.07.2032	558.340	0,73
217.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT <sup>†</sup>	2,88 %	15.10.2025	231.786	0,30
35.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT <sup>**</sup>	2,88 %	21.07.2026	37.374	0,05
26.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	1,75 %	13.07.2030	19.409	0,03
123.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	2,00 %	28.01.2032	88.168	0,12
100.000	Romanian Government International Bond <sup>**</sup>	2,88 %	26.05.2028	92.627	0,12
69.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	3,38 %	28.01.2050	42.791	0,06
15.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	3,62 %	26.05.2030	13.188	0,02
37.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	3,75 %	07.02.2034	29.625	0,04
191.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	3,88 %	29.10.2035	151.004	0,20
23.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	4,13 %	11.03.2039	17.644	0,02
100.000	Serbia International Bond <sup>†</sup>	2,05 %	23.09.2036	60.610	0,08
18.300	Slovakia Government Bond <sup>†</sup>	0,38 %	21.04.2036	12.469	0,02
15.500	Slovakia Government Bond <sup>†</sup>	4,00 %	19.10.2032	17.018	0,02
471.000	Slovenia Government Bond <sup>†</sup>	2,25 %	03.03.2032	446.982	0,59

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 32,47 % (31. Dezember 2021: 27,03 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
43.000	Spain Government Bond*	0,80 %	30.07.2027	41.424	0,06
37.000	Spain Government Bond*	1,30 %	31.10.2026	37.103	0,05
14.000	Spain Government Bond*	1,40 %	30.04.2028	13.669	0,02
70.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,45 %	16.02.2043	55.988	0,07
12.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,65 %	22.02.2038	10.431	0,01
<b>Euro insgesamt</b>				<b>5.925.902</b>	<b>7,79</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>					
5.237.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	324.042	0,42
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>				<b>324.042</b>	<b>0,42</b>
<b>Japanischer Yen</b>					
17.000.000	Japan Government Thirty Year Bond*	0,70 %	20.12.2048	106.443	0,14
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>				<b>106.443</b>	<b>0,14</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
30.400.000	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	1.444.773	1,90
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>1.444.773</b>	<b>1,90</b>
<b>Neuseeländischer Dollar</b>					
5.766.000	New Zealand Government Bond*	3,50 %	14.04.2033	3.356.747	4,41
600.000	New Zealand Government Bond*	4,25 %	15.05.2034	369.703	0,49
<b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>				<b>3.726.450</b>	<b>4,90</b>
<b>Polnischer Zloty</b>					
2.266.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25 %	25.10.2030	347.647	0,46
<b>Polnischer Zloty insgesamt</b>				<b>347.647</b>	<b>0,46</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
715.000	United Kingdom Gilt*	1,25 %	31.07.2051	465.305	0,61
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>465.305</b>	<b>0,61</b>
<b>Thailändischer Baht</b>					
9.569.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.12.2031	265.740	0,35
<b>Thailändischer Baht insgesamt</b>				<b>265.740</b>	<b>0,35</b>
<b>US-Dollar</b>					
220.000	Angolan Government International Bond*	9,38 %	08.05.2048	174.942	0,23
200.000	Arab Republic of Egypt*	8,88 %	29.05.2050	135.924	0,18

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 32,47 % (31. Dezember 2021: 27,03 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
122.337	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	32.781	0,04
800.000	Argentine Republic Government International Bond*	1,50 %	09.07.2035	204.917	0,27
100.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	07.01.2041	84.942	0,11
90.000	Brazilian Government International Bond*	8,25 %	20.01.2034	101.437	0,13
200.000	Colombia Government International Bond*	3,88 %	25.04.2027	177.691	0,23
300.000	Colombia Government International Bond*	6,13 %	18.01.2041	239.633	0,31
200.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25 %	23.10.2023	179.958	0,24
160.000	Dominican Republic International Bond*	4,88 %	23.09.2032	133.412	0,18
150.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	19.07.2028	145.126	0,19
100.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	87.179	0,11
12.974	Ecuador Government International Bond*	0,00 %	31.07.2030	5.132	0,01
45.400	Ecuador Government International Bond*	1,50 %	31.07.2040	18.697	0,02
289.060	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2035	134.337	0,18
117.800	Ecuador Government International Bond*	5,50 %	31.07.2030	76.284	0,10
229.000	Egypt Government International Bond*	8,50 %	31.01.2047	153.172	0,20
200.000	El Salvador Government International Bond*	8,63 %	28.02.2029	89.400	0,12
200.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	141.740	0,19
100.000	Indonesia Government International Bond*	8,50 %	12.10.2035	127.097	0,17
112.000	Lebanon Government International Bond*	6,38 %	01.01.2025	6.906	0,01
220.000	Lebanon Government International Bond*	6,60 %	27.11.2026	13.470	0,02
108.000	Lebanon Government International Bond*	6,65 %	26.02.2030	6.593	0,01
62.000	Lebanon Government International Bond*	8,25 %	17.05.2034	3.844	0,01
220.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	185.711	0,24
200.000	Oman Government International Bond*	6,00 %	01.08.2029	201.413	0,26
200.000	Panama Government International Bond*	2,25 %	29.09.2032	148.851	0,20
200.000	Paraguay Government International Bond*	4,95 %	28.04.2031	194.026	0,26
200.000	Qatar Government International Bond*	4,40 %	16.04.2050	183.806	0,24
200.000	Republic of South Africa Government International Bond*	4,85 %	27.09.2027	190.500	0,25
200.000	Republic of South Africa Government International Bond*	7,30 %	20.04.2052	173.210	0,23
200.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	4,75 %	20.02.2024	196.214	0,26
200.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	64.050	0,08
200.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85 %	14.03.2029	64.050	0,08
120.000	Ukraine Government International Bond*	0,00 %	01.08.2041	35.376	0,05
100.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	21.913	0,03
150.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	32.691	0,04
418.000	United States Treasury Note/Bond*	1,88 %	15.02.2032	354.729	0,47
209.000	United States Treasury Note/Bond*	2,00 %	15.08.2051	136.919	0,18
364.000	United States Treasury Note/Bond*	2,25 %	15.02.2052	253.264	0,33
137.000	United States Treasury Note/Bond*	2,38 %	15.05.2029	124.574	0,16
262.000	United States Treasury Note/Bond*	2,63 %	31.07.2029	241.311	0,32

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 32,47 % (31. Dezember 2021: 27,03 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
355.000	United States Treasury Note/Bond <sup>†</sup>	2,75 %	31.07.2027	335.919	0,44
1.070.000	United States Treasury Note/Bond <sup>†</sup>	3,00 %	31.07.2024	1.043.835	1,37
1.240.000	United States Treasury Note/Bond <sup>†</sup>	3,25 %	30.06.2027	1.199.409	1,58
117.000	United States Treasury Note/Bond <sup>†</sup>	3,25 %	15.05.2042	102.631	0,13
65.000	United States Treasury Note/Bond <sup>†</sup>	3,50 %	15.02.2039	61.105	0,08
200.000	Zambia Government International Bond <sup>†</sup>	8,97 %	30.07.2027	90.005	0,12
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>8.110.126</b>	<b>10,66</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>24.711.043</b>	<b>32,47</b>
<b>Mortgage-Backed Securities 13,74 % (31. Dezember 2021: 6,46 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
187.291	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.01.2052	159.109	0,21
213.722	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.04.2052	181.461	0,24
57.841	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.11.2045	51.966	0,07
49.521	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.08.2046	44.376	0,06
77.046	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.01.2050	68.135	0,09
93.268	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.03.2050	82.447	0,11
83.037	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2050	73.403	0,10
121.723	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.06.2052	106.951	0,14
40.069	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.03.2047	37.209	0,05
63.141	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.09.2047	58.589	0,08
77.391	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.02.2048	71.843	0,09
80.186	Fannie Mae Pool (BH9277)	3,50 %	01.02.2048	74.380	0,10
405.000	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.01.2053	367.989	0,48
81.193	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2048	77.321	0,10
24.838	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.10.2048	23.706	0,03
70.446	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2049	67.037	0,09
202.857	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.04.2052	190.793	0,25
173.517	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.06.2052	162.928	0,21
129.422	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2052	122.101	0,16
169.909	Fannie Mae Pool (MA4655)	4,00 %	01.07.2052	159.593	0,21
1.050.000	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.01.2053	984.871	1,29
1.155.000	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.01.2053	1.111.767	1,46
146.694	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	144.803	0,19
870.000	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2053	857.414	1,13
1.190.000	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.01.2053	1.193.307	1,57
760.000	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.01.2053	771.452	1,01
86.566	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.08.2051	73.594	0,10
216.140	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.01.2052	183.635	0,24
240.276	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.04.2052	203.813	0,27



## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Mortgage-Backed Securities 13,74 % (31. Dezember 2021: 6,46 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
131.616	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.06.2052	111.604 0,15
19.048	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.03.2050	17.075 0,02
108.694	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.07.2050	96.181 0,13
216.368	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.05.2052	196.992 0,26
229.886	Freddie Mac Pool (QE2482)	3,50 %	01.05.2052	209.157 0,27
168.158	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.06.2052	153.081 0,20
171.312	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.08.2052	160.858 0,21
285.885	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.08.2052	275.448 0,36
197.953	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.11.2052	195.401 0,26
510.000	Ginnie Mae	5,00 %	01.01.2053	505.431 0,66
470.000	Ginnie Mae	5,50 %	01.01.2053	472.775 0,62
246.225	Ginnie Mae II Pool	2,50 %	20.05.2052	213.587 0,28
148.943	Ginnie Mae II Pool	4,50 %	20.09.2052	144.650 0,19
<b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>				<b>10.458.233 13,74</b>

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Investmentfonds 2,37 % (31. Dezember 2021: 6,11 %)</b>		
<b>Britisches Pfund</b>		
125.000	NB Global Monthly Income Fund Ltd	107.216 0,14
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>107.216 0,14</b>
<b>US-Dollar</b>		
200.000	Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund	1.694.000 2,23
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>1.694.000 2,23</b>
<b>Investmentfonds insgesamt #</b>		<b>1.801.216 2,37</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>77.000.113 101,17</b>

Devisenterminkontrakte 2,72 % (31. Dezember 2021: 1,36 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
2.215.707 AUD	1.413.232 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	4	90.255	0,12
1.125.923 AUD	733.337 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	30.667	0,04
113.307 AUD	73.013 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	3.872	0,01
557.447 AUD	373.757 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	4.503	0,01
1.121.555 AUD	758.480 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	2.561	0,00
1.979.326 BRL	368.384 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	5.400	0,01
518.372 CAD	376.312 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	6.291	0,01
582.760 CAD	426.327 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	3.799	0,01
681.149 CAD	496.661 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	6.086	0,01

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,72 % (31. Dezember 2021: 1,36 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
65.059 CAD	47.978 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	41	0,00
1.088.439 CHF	1.097.570 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	3	80.742	0,11
881.292 CHF	945.151 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	8.910	0,01
350.269 CHF	378.489 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	702	0,00
181.063.525 CLP	182.662 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	29.568	0,04
332.425 CNY	47.865 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	280	0,00
356.821 CNY	49.823 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	1.856	0,00
11.739.311 CZK	510.192 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	8.061	0,01
11.155.207 CZK	489.329 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	3.138	0,00
1.189.589 CZK	47.560 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	4.957	0,01
1.764.468 €	1.813.659 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	5	71.374	0,09
104.373 €	103.721 US\$	18.01.2023	Deutsche Bank AG	2	7.783	0,01
666.318 €	691.583 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	20.264	0,03
77.955 €	82.660 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	622	0,00
770.750 €	775.553 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	2	47.862	0,06
355.965 €	375.779 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	4.509	0,01
1.069.314 €	1.077.095 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	4	65.285	0,09
1.810.977 €	1.850.947 US\$	18.01.2023	UBS AG	7	83.773	0,11
733.877 €	736.623 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	47.399	0,06
321.721 £	371.388 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	15.764	0,02
23.315 HUF	53 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	9	0,00
5.910.217.900 IDR	378.569 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	4.169	0,01
118.879.326 ¥	848.409 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	3	54.313	0,07
417.323.417 ¥	2.953.548 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	5	215.437	0,28
29.714.947 ¥	218.096 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	7.547	0,01
6.943.033 ¥	47.823 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	4.900	0,01
251.976.786 KRW	179.265 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	21.021	0,03
58.157.871 KRW	45.700 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	527	0,00
7.420.368 MXN	364.825 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	14.919	0,02
24.036.206 MXN	1.211.298 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	18.776	0,03
1.061.182 NOK	99.587 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	8.201	0,01
2.798.283 NOK	275.594 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	8.639	0,01
449.942 NZD	261.961 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	22.665	0,03
275.194 NZD	158.141 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	15.942	0,02
215.707 NZD	129.493 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	6.960	0,01
613.261 NZD	354.223 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	33.715	0,04
3.552.093 NZD	2.019.672 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	227.319	0,30
1.682.351 PLN	380.617 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	2.502	0,00
226.220 PLN	47.287 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	4.230	0,01
4.148.531 SEK	398.012 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	481	0,00
7.277.396 SEK	666.970 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	32.070	0,04

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,72 % (31. Dezember 2021: 1,36 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
4.701.524 SEK	426.660 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	24.952	0,03
372.519 US\$	496.892 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	1	5.770	0,01
1.301.263 US\$	1.067.483 £	18.01.2023	BNP Paribas	3	16.678	0,02
331.751 US\$	5.090.055.017 IDR	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2.126	0,00
386.421 US\$	606.386 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2.832	0,00
350.541 US\$	470.618 CAD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	3.184	0,00
376.258 US\$	1.988.899 BRL	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	666	0,00
381.948 US\$	316.588 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	973	0,00
378.008 US\$	3.717.122 NOK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	444	0,00
380.704 US\$	598.156 NZD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	2.321	0,00
371.493 US\$	3.639.603 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.804	0,00
198.347 US\$	312.257 NZD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	819	0,00
380.253 US\$	557.836 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.729	0,00
756.434 US\$	1.191.642 NZD	18.01.2023	UBS AG	1	2.622	0,00
56.286 US\$	75.051 CAD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	892	0,00
63.531 US\$	59.428 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	42	0,00
1.113.287 ZAR	61.438 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	3.908	0,01
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
98.937 €	100.928 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	4.769	0,01
65.625 €	68.597 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	1.512	0,00
8.627.901 €	8.588.017 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	629.422	0,83
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
119 £	142 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1	0,00
10.387 £	11.690 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	809	0,00
11.270 £	12.758 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	805	0,00
238 US\$	197 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1	0,00
192 US\$	159 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b>					<b>2.069.747</b>	<b>2,72</b>

### Futures-Kontrakte 0,75 % (31. Dezember 2021: 0,21 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(47)	Euro-BOBL Future March 2023	179.778	0,23
(4)	Euro-BTP Future March 2023	28.453	0,04
(19)	Euro-Bund Future March 2023	172.980	0,23
(10)	Euro-OAT Future March 2023	96.821	0,13
2	Euro-Bund Put Option on Future February 2023, Strike Price EUR 136	5.841	0,01
(42)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2023	79.150	0,10
7	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	5.593	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>568.616</b>	<b>0,75</b>

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2021: 0,06 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
USD	250.000	07.12.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	2,43 %	1D SOFR	17.390	0,02
KRW	3.244.521.000	14.09.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	3,34 %	3M KORIBOR	26	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten<sup>∞</sup></b>							<b>17.416</b>	<b>0,02</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,60 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
USD	7.778.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on CDX.EM.38	455.060	0,60
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt<sup>*</sup></b>					<b>455.060</b>	<b>0,60</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>80.110.952</b>	<b>105,26</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (6,38 %) (31. Dezember 2021: (0,89 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.553.648 BRL	296.691 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(3.294)	(0,01)
485.229 CAD	364.190 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(6.050)	(0,01)
1.483.378 CAD	1.103.769 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(8.910)	(0,01)
1.014.522 CAD	749.379 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(574)	(0,00)
477.915 CAD	359.922 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(7.179)	(0,01)
348.943 CHF	378.882 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(1.127)	(0,00)
356.549 €	382.924 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(2.012)	(0,00)
46.850 £	56.546 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(168)	(0,00)
284.437 £	342.771 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(486)	(0,00)
150.000 £	172.036 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(3.285)	(0,00)
86.934 NZD	55.226 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(233)	(0,00)
71.136 NZD	45.881 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(881)	(0,00)
1.114.259 SEK	108.019 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(988)	(0,00)
7.709.085 SEK	751.017 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(10.510)	(0,01)
90.690 US\$	2.093.129 CZK	18.01.2023	BNP Paribas	1	(1.715)	(0,00)
1.106.309 US\$	1.067.017 CHF	18.01.2023	BNP Paribas	3	(48.813)	(0,06)

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (6,38 %) (31. Dezember 2021: (0,89 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht-realisiertes % des Nettovermögens	Verlust US\$
282.626 US\$	5.567.726 MXN	18.01.2023	BNP Paribas	1	(2.308)	(0,00)
562.840 US\$	951.331 NZD	18.01.2023	BNP Paribas	2	(38.955)	(0,05)
338.626 US\$	301.929 £	18.01.2023	BNP Paribas	1	(24.708)	(0,03)
1.092.422 US\$	157.715.844 ¥	18.01.2023	BNP Paribas	3	(105.209)	(0,14)
348.862 US\$	474.861 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(1.626)	(0,00)
360.303 US\$	570.522 AUD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(26.829)	(0,04)
1.477.776 US\$	1.470.666 €	18.01.2023	BNP Paribas	4	(93.379)	(0,12)
166.349 US\$	150.000 £	18.01.2023	Deutsche Bank AG	1	(14.157)	(0,02)
398.082 US\$	395.645 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(30.232)	(0,04)
460.433 US\$	4.824.111 SEK	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(2.954)	(0,00)
157.949 US\$	150.176.202 CLP	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(18.077)	(0,02)
4.833.936 US\$	4.372.609 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(427.959)	(0,56)
192.433 US\$	270.486.133 KRW	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(22.565)	(0,03)
1.201.916 US\$	30.244.809 CZK	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(133.296)	(0,18)
137.013 US\$	2.722.208 MXN	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(2.298)	(0,00)
880.967 US\$	1.498.072 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(66.687)	(0,09)
540.751 US\$	73.750.729 ¥	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(19.282)	(0,03)
1.394.390 US\$	1.360.563 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	7	(59.140)	(0,08)
45.895 US\$	62.310 CAD	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(95)	(0,00)
71.869 US\$	63.627 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(4.699)	(0,01)
1.389.546 US\$	28.262.734 MXN	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(56.824)	(0,08)
1.629 US\$	33.551 TRY	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(143)	(0,00)
1.234.918 US\$	177.061.927 ¥	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(109.620)	(0,14)
376 US\$	2.687 CNY	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(13)	(0,00)
1.409.117 US\$	2.186.763 AUD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(74.729)	(0,10)
39.092 US\$	708.353 ZAR	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(2.487)	(0,00)
1.477.526 US\$	1.394.216 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	5	(11.957)	(0,02)
225.075 US\$	310.308 CAD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(3.959)	(0,01)
365.433 US\$	3.915.032 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(32.233)	(0,04)
2.587.566 US\$	2.451.302 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	8	(31.232)	(0,04)
144.327 US\$	241.762 NZD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(8.607)	(0,01)
498.926 US\$	5.200.695 SEK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(634)	(0,00)
59.286 US\$	8.187.608 ¥	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(2.888)	(0,00)
379.962 US\$	564.139 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(2.839)	(0,00)
102.657 US\$	89.478 £	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(5.018)	(0,01)
341.965 US\$	3.668.839 NOK	18.01.2023	UBS AG	1	(30.694)	(0,04)
379.378 US\$	354.119 CHF	18.01.2023	UBS AG	1	(3.981)	(0,01)
1.453.314 US\$	2.005.120 CAD	18.01.2023	UBS AG	2	(26.637)	(0,04)
32.211.690 US\$	32.495.201 €	18.01.2023	UBS AG	7	(2.503.885)	(3,29)
316.655 US\$	1.594.853 PLN	18.01.2023	UBS AG	1	(46.539)	(0,06)
96.189 US\$	126.491.760 KRW	18.01.2023	UBS AG	2	(4.353)	(0,01)

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (6,38 %) (31. Dezember 2021: (0,89 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
132.495 US\$	702.202 BRL	18.01.2023	UBS AG	2	(112)	(0,00)
3.618.662 US\$	25.784.884 CNY	18.01.2023	UBS AG	2	(115.816)	(0,15)
467 US\$	5.143 SEK	18.01.2023	UBS AG	1	(27)	(0,00)
404.526 US\$	54.031.723 ¥	18.01.2023	UBS AG	1	(5.769)	(0,01)
256.738 US\$	223.711 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(12.470)	(0,02)
4.031.574 US\$	7.106.088 NZD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(463.611)	(0,61)
1.535.913 US\$	1.506.637 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	(73.671)	(0,10)
242.543 US\$	9.000.000 THB	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(17.688)	(0,02)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
82.019 US\$	77.264 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(524)	(0,00)
66.771 US\$	62.512 €	18.01.2023	UBS AG	1	(13)	(0,00)
200.396 US\$	204.276 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(17.838)	(0,02)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
376 £	460 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(7)	(0,00)
121 US\$	109 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(10)	(0,00)
312 US\$	280 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(25)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(4.857.533)</b>	<b>(6,38)</b>

### Futures-Kontrakte (0,80 %) (31. Dezember 2021: (0,33 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
81	10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2023	(169.972)	(0,22)
1	3-Month Euro EURIBOR Future December 2023	(5.003)	(0,01)
10	Australian Government Bond 10-Year Future March 2023	(43.875)	(0,06)
20	Canadian 10-Year Bond Future March 2023	(35.426)	(0,05)
9	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	(264.721)	(0,35)
24	Euro-Schatz Future March 2023	(29.456)	(0,04)
1	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	(6.171)	(0,01)
4	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(1.809)	(0,00)
63	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	(42.102)	(0,05)
32	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	(3.044)	(0,00)
9	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	(5.585)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>(607.164)</b>	<b>(0,80)</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,09 %) (31. Dezember 2021: (1,73 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
EUR 5.575.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover S38	(64.729)	(0,09)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b>				<b>(64.729)</b>	<b>(0,09)</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2021: (0,07 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
KRW	884.790.000	14.09.2042	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,09 %	3M KORIBOR	(15)	(0,00)
KRW	369.858.000	11.02.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,36 %	3M KORIBOR	(21)	(0,00)
KRW	7.398.466.000	14.09.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,57 %	3M KORIBOR	(23)	(0,00)
KRW	730.294.000	18.02.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,37 %	3M KORIBOR	(41)	(0,00)
KRW	1.267.973.000	11.08.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,88 %	3M KORIBOR	(41)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>							<b>(141)</b>	<b>(0,00)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(5.529.567)</b>	<b>(7,27)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>74.581.385</b>	<b>97,99</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>1.524.058</b>	<b>2,01</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>76.105.443</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	44.931.550	50,76
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	29.976.792	33,87
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	290.555	0,33
μ Investmentfonds	1.801.216	2,03
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(38.548)	(0,04)
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(2.380.180)	(2,69)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>74.581.385</b>	<b>84,26</b>

## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Aktien 17,55 % (31. Dezember 2021: 14,85 %)</b>			
<b>Euro</b>			
22.689	Cellnex Telecom SA	750.373	1,92
9.246	Vonovia SE	217.152	0,56
<b>Euro insgesamt</b>		<b>967.525</b>	<b>2,48</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
144.000	China Resources Land Ltd	659.581	1,69
142.000	CK Asset Holdings Ltd	874.202	2,24
118.000	New World Development Co Ltd	332.609	0,85
40.883	Sun Hung Kai Properties Ltd	559.428	1,44
79.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	460.541	1,18
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>2.886.361</b>	<b>7,40</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
63.500	Mitsubishi Estate Co Ltd	823.438	2,11
58.600	Mitsui Fudosan Co Ltd	1.073.449	2,75
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>1.896.887</b>	<b>4,86</b>
<b>Singapur-Dollar</b>			
218.600	UOL Group Ltd	1.095.282	2,81
<b>Singapur-Dollar insgesamt</b>		<b>1.095.282</b>	<b>2,81</b>
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>6.846.055</b>	<b>17,55</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften 77,80 % (31. Dezember 2021: 84,70 %)</b>			
<b>Australischer Dollar</b>			
232.519	Charter Hall Retail REIT	603.925	1,55
371.717	Region RE Ltd	683.136	1,75
<b>Australischer Dollar insgesamt</b>		<b>1.287.061</b>	<b>3,30</b>
<b>Kanadischer Dollar</b>			
10.302	Canadian Apartment Properties REIT	324.506	0,83
42.216	RioCan Real Estate Investment Trust	658.344	1,69
49.667	Summit Industrial Income REIT	831.724	2,13
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>		<b>1.814.574</b>	<b>4,65</b>
<b>Euro</b>			
3.909	ARGAN SA	316.293	0,81
6.386	Gecina SA	648.661	1,66
<b>Euro insgesamt</b>		<b>964.954</b>	<b>2,47</b>



## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Immobilienaktiengesellschaften 77,80 % (31. Dezember 2021: 84,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong-Dollar</b>			
22.500	Link REIT	165.184	0,42
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>165.184</b>	<b>0,42</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
697	LaSalle Logiport REIT	845.729	2,17
237	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc	863.973	2,21
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>1.709.702</b>	<b>4,38</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
99.273	Great Portland Estates Plc	588.702	1,51
53.788	Land Securities Group Plc	399.847	1,03
56.543	Safestore Holdings Plc	641.556	1,64
89.690	Segro Plc	822.113	2,11
57.690	UNITE Group Plc	629.732	1,61
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>3.081.950</b>	<b>7,90</b>
<b>Singapur-Dollar</b>			
325.200	Mapletree Pan Asia Commercial Trust	404.924	1,04
<b>Singapur-Dollar insgesamt</b>		<b>404.924</b>	<b>1,04</b>
<b>US-Dollar</b>			
10.490	American Homes 4 Rent Class A	316.168	0,81
9.234	American Tower Corp	1.956.315	5,01
16.139	Apartment Income REIT Corp	553.729	1,42
4.134	Boston Properties Inc	279.376	0,72
9.049	Crown Castle Inc	1.227.407	3,15
7.675	Digital Realty Trust Inc	769.572	1,97
1.124	Equinix Inc	736.254	1,89
6.432	Equity LifeStyle Properties Inc	415.507	1,06
10.822	Equity Residential	638.498	1,64
3.280	Essex Property Trust Inc	695.098	1,78
3.784	Extra Space Storage Inc	556.929	1,43
19.350	Healthpeak Properties Inc	485.105	1,24
14.441	Invitation Homes Inc	428.031	1,10
11.113	Iron Mountain Inc	553.983	1,42
36.844	Kimco Realty Corp	780.356	2,00
3.330	Life Storage Inc	328.005	0,84
32.646	Medical Properties Trust Inc	363.676	0,93
18.168	Prologis Inc	2.048.079	5,25
4.922	Public Storage	1.379.095	3,53

## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Immobilienaktiengesellschaften 77,80 % (31. Dezember 2021: 84,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
13.110	Realty Income Corp	831.567	2,13
13.446	Retail Opportunity Investments Corp	202.093	0,52
6.755	Rexford Industrial Realty Inc	369.093	0,95
2.239	SBA Communications Corp Class A	627.614	1,61
5.451	Simon Property Group Inc	640.384	1,64
10.810	Spirit Realty Capital Inc	431.643	1,10
4.251	Sun Communities Inc	607.893	1,56
8.906	UDR Inc	344.930	0,88
14.540	Ventas Inc	655.027	1,68
10.035	VICI Properties Inc	325.134	0,83
15.815	Welltower Inc	1.036.673	2,66
11.265	Weyerhaeuser Co	349.215	0,89
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>20.932.449</b>	<b>53,64</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>		<b>30.360.798</b>	<b>77,80</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>37.206.853</b>	<b>95,35</b>

Devisenterminkontrakte 2,22 % (31. Dezember 2021: 0,03 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
825.145 €	839.867 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	41.661	0,10
145.250 €	150.240 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	4.935	0,01
11.810.919 €	11.805.613 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	33	812.338	2,09
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
2.818 £	3.284 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	107	0,00
40.868 £	46.024 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	3.156	0,01
59.103 £	67.396 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	3.727	0,01
717 US\$	594 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2	0,00
7.802 US\$	6.410 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	89	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b>					<b>866.015</b>	<b>2,22</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>38.072.868</b>	<b>97,57</b>

## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,38 %) (31. Dezember 2021: (0,40 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
176.694 €	189.440 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(672)	(0,00)
221.825 €	237.140 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(158)	(0,00)
743.201 US\$	730.578 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(37.297)	(0,10)
154.499 US\$	146.303 €	18.01.2023	UBS AG	2	(1.801)	(0,00)
2.220.423 US\$	2.178.256 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	21	(106.671)	(0,28)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
5.391 £	6.617 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	(129)	(0,00)
19.945 US\$	17.434 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	(1.035)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(147.763)</b>	<b>(0,38)</b>
					<b>Zeitwert % des Netto-</b>	
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(147.763)</b>	<b>(0,38)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>37.925.105</b>	<b>97,19</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>1.097.315</b>	<b>2,81</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>39.022.420</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>					<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind					37.206.853	94,63
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente					718.252	1,83
<b>Anlagen insgesamt</b>					<b>37.925.105</b>	<b>96,46</b>

## Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Aktien 99,20 % (31. Dezember 2021: 99,29 %)</b>			
<b>Dänische Krone</b>			
15.415	Novo Nordisk A/S Class B	2.087.272	1,59
	<b>Dänische Krone insgesamt</b>	<b>2.087.272</b>	<b>1,59</b>
<b>Euro</b>			
2.254	Adyen NV	3.119.761	2,37
40.317	Alfen Beheer BV	3.639.309	2,77
5.760	ASML Holding NV	3.131.263	2,38
110.857	HelloFresh SE	2.412.205	1,83
100.384	TeamViewer AG	1.283.829	0,97
	<b>Euro insgesamt</b>	<b>13.586.367</b>	<b>10,32</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
49.900	Recruit Holdings Co Ltd	1.579.691	1,20
	<b>Japanischer Yen insgesamt</b>	<b>1.579.691</b>	<b>1,20</b>
<b>Norwegische Krone</b>			
69.170	Bakkafrost P/F	4.294.333	3,26
	<b>Norwegische Krone insgesamt</b>	<b>4.294.333</b>	<b>3,26</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
260.401	3i Group Plc	4.178.560	3,18
	<b>Britisches Pfund insgesamt</b>	<b>4.178.560</b>	<b>3,18</b>
<b>Schwedische Krone</b>			
84.371	Assa Abloy AB Class B	1.817.432	1,38
163.257	Atlas Copco AB Class A	1.937.183	1,47
	<b>Schwedische Krone insgesamt</b>	<b>3.754.615</b>	<b>2,85</b>
<b>Schweizer Franken</b>			
20.557	Nestle SA	2.373.116	1,81
2.605	Partners Group Holding AG	2.305.314	1,75
11.262	Straumann Holding AG	1.290.659	0,98
	<b>Schweizer Franken insgesamt</b>	<b>5.969.089</b>	<b>4,54</b>
<b>US-Dollar</b>			
18.105	Abbott Laboratories	1.987.748	1,51
9.719	Adobe Inc	3.270.735	2,49
80.166	Alphabet Inc Class A	7.073.046	5,38
70.295	Amazon.com Inc	5.904.780	4,49
31.664	Applied Materials Inc	3.083.440	2,34

## Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Aktien 99,20 % (31. Dezember 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
62.955	Brown & Brown Inc	3.586.546	2,73
12.086	Danaher Corp	3.207.866	2,44
6.999	Elevance Health Inc	3.590.277	2,73
13.961	Estee Lauder Cos Inc Class A	3.463.864	2,63
8.214	Intuit Inc	3.197.053	2,43
12.719	Marsh & McLennan Cos Inc	2.104.740	1,60
7.852	Mastercard Inc Class A	2.730.376	2,07
44.669	Match Group Inc	1.853.317	1,41
32.626	Microsoft Corp	7.824.367	5,95
12.641	Moody's Corp	3.522.035	2,68
57.333	Nasdaq Inc	3.517.380	2,67
12.496	Netflix Inc	3.684.820	2,80
36.141	NIKE Inc Class B	4.228.858	3,21
9.369	Nordson Corp	2.227.199	1,69
14.486	S&P Global Inc	4.851.941	3,69
6.850	SolarEdge Technologies Inc	1.940.400	1,47
9.358	Thermo Fisher Scientific Inc	5.153.357	3,92
6.466	Ulta Beauty Inc	3.033.007	2,30
10.843	UnitedHealth Group Inc	5.748.742	4,37
13.475	Visa Inc Class A	2.799.566	2,13
10.161	Zoetis Inc Class A	1.489.095	1,13
	<b>US-Dollar insgesamt</b>	<b>95.074.555</b>	<b>72,26</b>
	<b>Aktien insgesamt *</b>	<b>130.524.482</b>	<b>99,20</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>130.524.482</b>	<b>99,20</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>130.524.482</b>	<b>99,20</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>		<b>130.524.482</b>	<b>99,20</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>		<b>1.053.717</b>	<b>0,80</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>131.578.199</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind		130.524.482	95,90
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>130.524.482</b>	<b>95,90</b>

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,95 % (31. Dezember 2021: 1,35 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
2.375.000	37 Capital CLO II Series 2022-1X Class E	12,98 %	15.07.2034	2.247.145	0,10
1.000.000	AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E	11,76 %	20.10.2034	870.166	0,04
2.000.000	AGL CLO 14 Ltd Series 2021-14X Class E	11,47 %	02.12.2034	1.766.613	0,08
4.500.000	AIG CLO LLC Series 2021-3X Class E	11,28 %	25.01.2035	3.973.886	0,17
1.400.000	Aimco CDO Series 2020-12X Class ER	10,76 %	17.01.2032	1.278.731	0,05
5.000.000	Ares XL CLO Ltd Series 2016-40X Class DR	11,14 %	15.01.2029	4.127.103	0,18
1.000.000	Benefit Street Partners CLO XII Ltd Series 2017-12X Class D	11,20 %	15.10.2030	845.456	0,03
1.350.000	Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R	11,35 %	24.07.2030	1.123.995	0,05
1.250.000	Grippen Park CLO Ltd Series 2017-1X Class E	10,51 %	20.01.2030	1.079.847	0,05
2.250.000	Symphony CLO XXIV Ltd Series 2020-24X Class E	11,82 %	23.01.2032	2.028.609	0,09
2.500.000	Trinitas CLO XXI Ltd Series 2022-21X Class D	10,95 %	20.01.2036	2.488.755	0,11
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>21.830.306</b>	<b>0,95</b>
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %)</b>					
<b>Euro</b>					
4.010.000	IQVIA Inc**	2,88 %	15.06.2028	3.839.814	0,16
<b>Euro insgesamt</b>				<b>3.839.814</b>	<b>0,16</b>
<b>US-Dollar</b>					
725.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	3,50 %	15.02.2029	622.821	0,03
5.195.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,00 %	15.10.2030	4.217.795	0,18
7.545.000	180 Medical Inc**	3,88 %	15.10.2029	6.497.339	0,28
1.120.000	Abercrombie & Fitch Management Co**	8,75 %	15.07.2025	1.099.406	0,05
3.160.000	Adient Global Holdings Ltd**	4,88 %	15.08.2026	2.946.510	0,13
4.950.000	Advanced Drainage Systems Inc**	6,38 %	15.06.2030	4.816.399	0,21
3.444.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	3.252.585	0,14
9.565.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63 %	01.05.2028	7.700.255	0,34
6.680.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy*	4,88 %	04.02.2028	5.437.127	0,24
2.820.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,50 %	15.03.2029	2.372.156	0,10
2.640.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,88 %	15.02.2030	2.360.780	0,10
19.693.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	17.743.590	0,77
4.660.000	Ally Financial Inc*	5,75 %	20.11.2025	4.519.270	0,20
14.445.000	Altice France Holding SA**	6,00 %	15.02.2028	8.557.821	0,37
10.755.000	Altice France SA*	5,50 %	15.01.2028	8.445.579	0,37
4.235.000	AMC Networks Inc**	4,25 %	15.02.2029	2.645.043	0,12
27.600.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	26.589.881	1,16
20.590.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75 %	20.04.2029	18.855.516	0,82
2.470.000	Amkor Technology Inc**	6,63 %	15.09.2027	2.448.384	0,11
675.000	AmWINS Group Inc**	4,88 %	30.06.2029	573.377	0,03
6.095.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75 %	01.03.2027	5.772.436	0,25

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.280.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	7,88 %	15.05.2026	4.338.641	0,19
3.000.000	APi Group DE Inc**	4,13 %	15.07.2029	2.490.000	0,11
1.135.000	APi Group DE Inc**	4,75 %	15.10.2029	989.692	0,04
9.640.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	7.996.253	0,35
8.545.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	8.238.234	0,36
3.325.000	Aramark Services Inc**	5,00 %	01.02.2028	3.108.775	0,14
1.880.000	Arconic Corp**	6,00 %	15.05.2025	1.852.922	0,08
920.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	4,00 %	01.09.2029	730.850	0,03
5.370.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	5.263.621	0,23
11.555.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	8.658.418	0,38
8.375.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	4,13 %	15.08.2026	7.271.703	0,32
575.000	Asbury Automotive Group Inc**	4,63 %	15.11.2029	485.196	0,02
13.275.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	11.853.646	0,52
2.375.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	2.307.478	0,10
4.140.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25 %	31.12.2028	4.063.429	0,18
2.683.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	9,00 %	01.11.2027	3.315.772	0,14
12.149.000	ASGN Inc**	4,63 %	15.05.2028	11.018.779	0,48
6.199.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	5.110.080	0,22
8.195.000	AssuredPartners Inc**	7,00 %	15.08.2025	7.938.193	0,35
955.000	AthenaHealth Group Inc**	6,50 %	15.02.2030	705.561	0,03
2.384.000	ATI Inc*	4,88 %	01.10.2029	2.109.852	0,09
3.325.000	ATI Inc*	5,88 %	01.12.2027	3.184.802	0,14
7.575.000	Avient Corp**	7,13 %	01.08.2030	7.415.031	0,32
8.395.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38 %	01.03.2029	7.192.320	0,31
3.445.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,75 %	15.07.2027	3.121.704	0,14
3.225.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	5,25 %	15.05.2024	3.162.554	0,14
1.755.000	Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**	4,75 %	15.06.2027	1.625.042	0,07
1.185.000	Ball Corp*	5,25 %	01.07.2025	1.171.571	0,05
5.930.000	Bank of America Corp**	6,13 %	29.12.2049	5.833.637	0,25
2.605.000	Bank of New York Mellon Corp**	3,70 %	29.12.2049	2.326.643	0,10
1.855.000	Bath & Body Works Inc**	6,63 %	01.10.2030	1.743.910	0,08
10.210.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63 %	01.05.2027	9.168.886	0,40
4.545.000	Berry Global Inc**	5,63 %	15.07.2027	4.441.646	0,19
1.390.000	Blackstone Mortgage Trust Inc**	3,75 %	15.01.2027	1.197.004	0,05
10.835.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88 %	15.04.2029	9.235.552	0,40
4.340.000	Buckeye Partners LP**	4,35 %	15.10.2024	4.199.595	0,18
8.865.000	Buckeye Partners LP**	4,50 %	01.03.2028	7.806.038	0,34
5.705.000	Buckeye Partners LP**	5,60 %	15.10.2044	4.210.410	0,18
7.204.000	Buckeye Partners LP**	5,85 %	15.11.2043	5.413.579	0,24
1.760.000	Builders FirstSource Inc**	5,00 %	01.03.2030	1.562.368	0,07

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.350.000	Builders FirstSource Inc**	6,38 %	15.06.2032	5.032.190	0,22
6.340.000	Cablevision Lightpath LLC**	5,63 %	15.09.2028	4.721.570	0,21
2.475.000	Caesars Entertainment Inc**	6,25 %	01.07.2025	2.409.921	0,11
3.380.000	Callon Petroleum Co**	7,50 %	15.06.2030	3.097.094	0,13
6.210.000	Callon Petroleum Co**	8,00 %	01.08.2028	5.927.934	0,26
4.619.000	Calpine Corp**	4,63 %	01.02.2029	3.970.764	0,17
6.912.000	Calpine Corp**	5,00 %	01.02.2031	5.809.598	0,25
1.340.000	Calpine Corp**	5,13 %	15.03.2028	1.198.399	0,05
8.380.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	7.700.591	0,34
83.000	Canpack SA/Canpack US LLC*	3,13 %	01.11.2025	73.044	0,00
5.220.000	Carnival Corp**	5,75 %	01.03.2027	3.736.319	0,16
3.795.000	Carnival Corp**	7,63 %	01.03.2026	3.014.614	0,13
3.510.000	Carnival Corp**	9,88 %	01.08.2027	3.322.759	0,14
5.370.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd**	10,38 %	01.05.2028	5.522.427	0,24
5.485.000	Carpenter Technology Corp*	7,63 %	15.03.2030	5.505.990	0,24
1.080.000	Cars.com Inc**	6,38 %	01.11.2028	960.647	0,04
2.472.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,13 %	15.02.2029	1.971.420	0,09
590.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,50 %	01.04.2030	466.610	0,02
3.290.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	01.02.2031	2.646.476	0,12
3.160.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	15.01.2034	2.338.400	0,10
13.575.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	15.08.2030	11.245.666	0,49
5.000.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.05.2032	3.989.625	0,17
5.800.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.03.2030	5.015.260	0,22
18.355.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	16.706.629	0,73
4.375.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	6,38 %	01.09.2029	4.119.784	0,18
2.275.000	CD&R Smokey Buyer Inc**	6,75 %	15.07.2025	1.963.598	0,09
2.335.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	6,50 %	01.10.2028	2.262.078	0,10
8.590.000	Centene Corp**	3,38 %	15.02.2030	7.281.099	0,32
8.818.000	Centene Corp**	4,63 %	15.12.2029	8.078.089	0,35
6.795.000	Central Parent Inc/CDK Global Inc**	7,25 %	15.06.2029	6.655.002	0,29
12.105.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	12.184.167	0,53
2.485.000	Chart Industries Inc**	9,50 %	01.01.2031	2.551.635	0,11
10.310.000	Chesapeake Energy Corp**	6,75 %	15.04.2029	10.051.735	0,44
5.330.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,25 %	15.05.2030	4.028.532	0,18
2.210.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63 %	15.03.2027	1.899.009	0,08
1.495.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00 %	15.01.2029	1.252.481	0,05
1.936.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00 %	15.12.2027	1.755.357	0,08
1.215.000	Churchill Downs Inc**	5,50 %	01.04.2027	1.153.163	0,05
4.680.000	Ciena Corp**	4,00 %	31.01.2030	4.124.882	0,18
2.340.000	Clarios Global LP**	6,75 %	15.05.2025	2.348.825	0,10



## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.380.000	Clarivate Science Holdings Corp**	4,88 %	01.07.2029	4.581.877	0,20
5.180.000	Colgate Energy Partners III LLC**	5,88 %	01.07.2029	4.455.632	0,19
3.865.000	CommScope Inc**	4,75 %	01.09.2029	3.123.210	0,14
530.000	CommScope Inc**	8,25 %	01.03.2027	411.587	0,02
18.132.000	CommScope Technologies LLC**	5,00 %	15.03.2027	12.343.932	0,54
1.299.000	CommScope Technologies LLC**	6,00 %	15.06.2025	1.184.766	0,05
11.750.000	Comstock Resources Inc**	5,88 %	15.01.2030	10.116.750	0,44
8.164.000	Comstock Resources Inc**	6,75 %	01.03.2029	7.382.787	0,32
13.300.000	Condor Merger Sub Inc**	7,38 %	15.02.2030	10.717.351	0,47
2.545.000	Consensus Cloud Solutions Inc**	6,00 %	15.10.2026	2.391.042	0,10
9.885.000	Consensus Cloud Solutions Inc**	6,50 %	15.10.2028	9.104.763	0,40
2.215.000	Consolidated Communications Inc**	5,00 %	01.10.2028	1.636.370	0,07
6.620.000	Consolidated Communications Inc**	6,50 %	01.10.2028	5.160.692	0,22
4.805.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13 %	15.01.2029	3.391.705	0,15
4.895.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	4.648.596	0,20
1.960.000	Coty Inc**	6,50 %	15.04.2026	1.884.638	0,08
7.780.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	6.810.457	0,30
2.830.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**	5,63 %	01.05.2027	2.636.768	0,11
515.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp*	5,75 %	01.04.2025	501.878	0,02
3.979.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**	6,00 %	01.02.2029	3.656.525	0,16
3.751.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**	8,00 %	01.04.2029	3.738.060	0,16
1.255.000	Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp V*	4,25 %	30.09.2026	1.198.901	0,05
7.470.000	CSC Holdings LLC**	4,63 %	01.12.2030	4.144.648	0,18
4.305.000	CSC Holdings LLC**	5,00 %	15.11.2031	2.410.800	0,11
33.815.000	CSC Holdings LLC**	5,75 %	15.01.2030	19.145.884	0,83
2.365.000	Dana Inc*	4,50 %	15.02.2032	1.894.576	0,08
5.835.000	DaVita Inc**	3,75 %	15.02.2031	4.367.818	0,19
8.390.000	DaVita Inc**	4,63 %	01.06.2030	6.766.885	0,29
9.735.000	DCP Midstream Operating LP**	5,85 %	21.05.2043	9.520.343	0,41
5.305.000	Diamond BC BV**	4,63 %	01.10.2029	4.264.159	0,19
6.175.000	Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co**	5,38 %	15.08.2026	733.281	0,03
7.170.000	DISH DBS Corp**	5,13 %	01.06.2029	4.638.882	0,20
1.620.000	DISH DBS Corp**	5,25 %	01.12.2026	1.367.620	0,06
12.135.000	DISH Network Corp**	3,38 %	15.08.2026	7.632.915	0,33
3.280.000	DISH Network Corp**	11,75 %	15.11.2027	3.382.172	0,15
2.555.000	DT Midstream Inc**	4,13 %	15.06.2029	2.199.944	0,10
2.088.000	Encompass Health Corp*	4,50 %	01.02.2028	1.899.976	0,08
15.695.000	Endurance International Group Holdings Inc**	6,00 %	15.02.2029	10.809.146	0,47
1.870.000	Energizer Holdings Inc**	6,50 %	31.12.2027	1.781.996	0,08
5.155.000	EnLink Midstream LLC**	6,50 %	01.09.2030	5.108.863	0,22

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.780.000	EnLink Midstream Partners LP <sup>+</sup>	5,05 %	01.04.2045	2.111.697	0,09
2.603.000	EnLink Midstream Partners LP <sup>+</sup>	5,45 %	01.06.2047	2.095.480	0,09
810.000	EnLink Midstream Partners LP <sup>+</sup>	5,60 %	01.04.2044	671.864	0,03
6.655.000	Envision Healthcare Corp <sup>**</sup>	8,75 %	15.10.2026	1.843.221	0,08
2.640.000	EPR Properties <sup>+</sup>	3,75 %	15.08.2029	2.071.816	0,09
1.200.000	EPR Properties <sup>+</sup>	4,50 %	01.04.2025	1.139.321	0,05
4.605.000	EQM Midstream Partners LP <sup>+</sup>	4,13 %	01.12.2026	4.104.999	0,18
4.170.000	EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>	4,50 %	15.01.2029	3.508.626	0,15
2.390.000	EQM Midstream Partners LP <sup>+</sup>	5,50 %	15.07.2028	2.141.328	0,09
2.342.000	EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>	6,00 %	01.07.2025	2.264.051	0,10
3.580.000	EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>	6,50 %	01.07.2027	3.427.850	0,15
1.880.000	EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>	7,50 %	01.06.2027	1.843.500	0,08
2.110.000	EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>	7,50 %	01.06.2030	2.035.939	0,09
1.435.000	Everi Holdings Inc <sup>**</sup>	5,00 %	15.07.2029	1.234.482	0,05
2.635.000	Fair Isaac Corp <sup>**</sup>	5,25 %	15.05.2026	2.584.013	0,11
5.500.000	First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>	6,88 %	15.10.2027	5.171.558	0,23
1.450.000	First Quantum Minerals Ltd <sup>**</sup>	7,50 %	01.04.2025	1.414.330	0,06
1.470.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd <sup>**</sup>	4,38 %	01.04.2031	1.225.404	0,05
4.650.000	Foot Locker Inc <sup>**</sup>	4,00 %	01.10.2029	3.629.321	0,16
1.550.000	Ford Motor Co <sup>+</sup>	5,29 %	08.12.2046	1.184.758	0,05
3.670.000	Ford Motor Co <sup>+</sup>	7,45 %	16.07.2031	3.759.427	0,16
6.015.000	Ford Motor Co <sup>+</sup>	9,63 %	22.04.2030	6.815.025	0,30
5.320.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>+</sup>	4,06 %	01.11.2024	5.119.287	0,22
5.060.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>+</sup>	4,13 %	17.08.2027	4.540.313	0,20
6.160.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>+</sup>	4,39 %	08.01.2026	5.751.931	0,25
2.635.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>+</sup>	5,11 %	03.05.2029	2.392.053	0,10
4.060.000	Ford Motor Credit Co LLC <sup>+</sup>	7,35 %	04.11.2027	4.170.432	0,18
1.640.000	Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>	5,00 %	01.05.2028	1.433.376	0,06
10.520.000	Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>	5,88 %	01.11.2029	8.152.746	0,35
6.260.000	Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>	6,00 %	15.01.2030	4.925.824	0,21
4.060.000	Frontier Communications Holdings LLC <sup>**</sup>	8,75 %	15.05.2030	4.135.900	0,18
3.795.000	Gap Inc <sup>**</sup>	3,63 %	01.10.2029	2.682.040	0,12
3.090.000	Garda World Security Corp <sup>**</sup>	4,63 %	15.02.2027	2.733.723	0,12
6.450.000	Garda World Security Corp <sup>**</sup>	6,00 %	01.06.2029	5.249.322	0,23
2.895.000	Gen Digital Inc <sup>**</sup>	6,75 %	30.09.2027	2.840.863	0,12
2.420.000	Gen Digital Inc <sup>**</sup>	7,13 %	30.09.2030	2.380.917	0,10
3.045.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp <sup>+</sup>	6,25 %	15.05.2026	2.790.884	0,12
3.885.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp <sup>+</sup>	6,50 %	01.10.2025	3.719.072	0,16
4.805.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp <sup>+</sup>	7,75 %	01.02.2028	4.430.498	0,19
2.745.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp <sup>+</sup>	8,00 %	15.01.2027	2.596.276	0,11

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
3.345.000	Glatfelter Corp**	4,75 %	15.11.2029	2.015.699	0,09
24.871.232	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50 %	15.09.2024	21.194.020	0,92
16.680.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	5,63 %	01.06.2029	13.105.783	0,57
4.000.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	7,50 %	15.04.2032	3.171.597	0,14
2.715.000	GLP Capital LP/GLP Financing II Inc**	3,25 %	15.01.2032	2.174.253	0,09
2.210.000	Golden Entertainment Inc**	7,63 %	15.04.2026	2.181.704	0,10
6.510.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	31.05.2026	6.151.440	0,27
1.425.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,25 %	30.04.2031	1.185.023	0,05
2.608.000	Graham Packaging Co Inc**	7,13 %	15.08.2028	2.180.216	0,10
4.155.000	Grifols Escrow Issuer SA <sup>†</sup>	4,75 %	15.10.2028	3.592.621	0,16
4.640.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00 %	15.05.2027	4.451.894	0,19
6.700.000	GYP Holdings III Corp**	4,63 %	01.05.2029	5.479.044	0,24
15.140.000	Harvest Midstream I LP**	7,50 %	01.09.2028	14.487.012	0,63
2.370.000	HCA Inc <sup>†</sup>	5,50 %	15.06.2047	2.116.011	0,09
1.867.000	HealthEquity Inc**	4,50 %	01.10.2029	1.633.905	0,07
2.445.000	Hertz Corp**	4,63 %	01.12.2026	2.050.744	0,09
7.595.000	Hertz Corp**	5,00 %	01.12.2029	5.771.440	0,25
2.793.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	5,75 %	01.02.2029	2.489.992	0,11
4.280.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00 %	15.04.2030	3.812.286	0,17
4.825.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00 %	01.02.2031	4.179.939	0,18
3.000.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25 %	01.11.2028	2.720.325	0,12
9.530.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	6,75 %	15.01.2027	9.146.857	0,40
2.325.000	HUB International Ltd**	7,00 %	01.05.2026	2.280.871	0,10
8.050.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	7.321.955	0,32
3.835.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13 %	01.04.2029	3.479.054	0,15
3.560.000	iHeartCommunications Inc**	6,38 %	01.05.2026	3.280.825	0,14
2.365.000	IHO Verwaltungs GmbH <sup>†</sup>	6,38 %	15.05.2029	2.002.741	0,09
3.060.000	Iliad Holding SASU**	6,50 %	15.10.2026	2.843.303	0,12
2.745.000	Iliad Holding SASU**	7,00 %	15.10.2028	2.484.555	0,11
10.035.000	Imola Merger Corp**	4,75 %	15.05.2029	8.726.723	0,38
7.830.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00 %	15.09.2028	6.330.324	0,28
6.854.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2027	6.314.110	0,27
2.460.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2029	2.149.745	0,09
2.390.000	Iron Mountain Inc**	5,00 %	15.07.2028	2.150.882	0,09
9.021.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.03.2028	8.313.663	0,36
3.960.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.07.2030	3.450.170	0,15
4.505.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	3.912.102	0,17
11.830.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	9.984.697	0,43
9.200.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc <sup>†</sup>	5,50 %	15.07.2029	6.527.456	0,28
3.980.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc <sup>†</sup>	5,88 %	15.01.2028	3.031.562	0,13

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.910.000	JELD-WEN Inc**	4,63 %	15.12.2025	4.118.901	0,18
7.370.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	5.558.822	0,24
7.165.000	JPMorgan Chase & Co**	4,60 %	29.12.2049	6.332.069	0,28
7.125.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	6.932.197	0,30
4.225.000	Kinetik Holdings LP**	5,88 %	15.06.2030	3.967.837	0,17
2.890.000	Korn Ferry**	4,63 %	15.12.2027	2.666.690	0,12
3.410.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2027	3.463.145	0,15
2.725.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	2.778.056	0,12
3.140.000	LCM Investments Holdings II LLC**	4,88 %	01.05.2029	2.518.558	0,11
5.845.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	5.001.379	0,22
7.160.000	Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc**	5,00 %	01.02.2026	6.381.350	0,28
3.290.000	Level 3 Financing Inc**	3,63 %	15.01.2029	2.414.534	0,11
10.185.000	Level 3 Financing Inc**	3,75 %	15.07.2029	7.340.331	0,32
28.196.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	23.522.513	1,02
3.620.000	Lindblad Expeditions LLC**	6,75 %	15.02.2027	3.288.480	0,14
3.285.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2029	1.908.903	0,08
1.160.000	Live Nation Entertainment Inc**	5,63 %	15.03.2026	1.098.797	0,05
5.955.000	Live Nation Entertainment Inc**	6,50 %	15.05.2027	5.839.355	0,25
3.015.000	LPL Holdings Inc**	4,00 %	15.03.2029	2.627.422	0,11
1.245.000	LPL Holdings Inc**	4,63 %	15.11.2027	1.165.073	0,05
11.145.000	Lumen Technologies Inc**	4,50 %	15.01.2029	7.707.402	0,34
2.770.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	01.04.2029	2.456.638	0,11
3.455.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	15.03.2030	3.003.086	0,13
1.540.000	Masonite International Corp**	5,38 %	01.02.2028	1.426.548	0,06
4.624.000	Match Group Holdings II LLC**	5,63 %	15.02.2029	4.308.528	0,19
1.165.000	Mattamy Group Corp**	4,63 %	01.03.2030	946.288	0,04
1.210.000	Mattamy Group Corp**	5,25 %	15.12.2027	1.075.186	0,05
6.460.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,25 %	15.04.2025	5.986.978	0,26
3.714.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	3.126.575	0,14
5.390.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	4.464.362	0,19
3.085.000	MDC Holdings Inc*	2,50 %	15.01.2031	2.231.280	0,10
7.450.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	6.017.700	0,26
18.565.000	Medline Borrower LP**	5,25 %	01.10.2029	14.778.761	0,64
10.570.000	Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp**	4,88 %	01.05.2029	9.007.375	0,39
3.560.000	MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp**	5,50 %	01.02.2030	2.838.922	0,12
7.975.000	Molina Healthcare Inc**	3,88 %	15.05.2032	6.634.278	0,29
230.000	Motion Bondco DAC**	6,63 %	15.11.2027	198.362	0,01
6.815.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,50 %	01.09.2028	5.330.284	0,23
19.565.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75 %	01.11.2028	13.054.007	0,57
5.220.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	4.399.207	0,19

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
8.805.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp <sup>*</sup>	5,25 %	01.08.2026	8.033.726	0,35
1.505.000	MSCI Inc <sup>**</sup>	3,25 %	15.08.2033	1.164.424	0,05
7.730.000	MSCI Inc <sup>**</sup>	4,00 %	15.11.2029	6.746.820	0,29
5.590.000	Nabors Industries Inc <sup>**</sup>	7,38 %	15.05.2027	5.421.460	0,24
3.110.000	Nabors Industries Ltd <sup>**</sup>	7,25 %	15.01.2026	2.935.775	0,13
3.435.000	NCL Corp Ltd <sup>**</sup>	3,63 %	15.12.2024	2.940.147	0,13
4.350.000	NCL Corp Ltd <sup>**</sup>	5,88 %	15.03.2026	3.424.320	0,15
3.429.000	NCL Corp Ltd <sup>**</sup>	5,88 %	15.02.2027	2.974.503	0,13
8.245.000	Necessity Retail REIT Inc/American Finance Operating Partner LP <sup>**</sup>	4,50 %	30.09.2028	6.072.195	0,26
16.255.000	New Fortress Energy Inc <sup>**</sup>	6,50 %	30.09.2026	15.126.903	0,66
4.165.000	New Fortress Energy Inc <sup>**</sup>	6,75 %	15.09.2025	3.948.920	0,17
2.390.000	NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC <sup>**</sup>	7,13 %	01.04.2026	2.244.419	0,10
10.180.000	Northern Oil & Gas Inc <sup>**</sup>	8,13 %	01.03.2028	9.787.500	0,43
5.640.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc <sup>**</sup>	4,75 %	30.04.2027	4.969.475	0,22
2.562.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc <sup>**</sup>	6,00 %	15.02.2028	1.986.916	0,09
3.335.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc <sup>**</sup>	10,75 %	01.06.2028	3.119.745	0,14
4.305.000	NOVA Chemicals Corp <sup>**</sup>	4,88 %	01.06.2024	4.174.951	0,18
2.735.000	NOVA Chemicals Corp <sup>**</sup>	5,00 %	01.05.2025	2.579.682	0,11
6.235.000	NOVA Chemicals Corp <sup>**</sup>	5,25 %	01.06.2027	5.614.886	0,24
7.195.000	NRG Energy Inc <sup>**</sup>	5,25 %	15.06.2029	6.363.402	0,28
3.835.000	Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>	5,50 %	01.12.2025	3.827.330	0,17
11.745.000	Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>	6,13 %	01.01.2031	11.875.541	0,52
9.190.000	Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>	7,50 %	01.05.2031	9.834.678	0,43
3.355.000	Olympus Water US Holding Corp <sup>**</sup>	4,25 %	01.10.2028	2.728.130	0,12
3.545.000	Olympus Water US Holding Corp <sup>**</sup>	6,25 %	01.10.2029	2.695.994	0,12
2.795.000	Olympus Water US Holding Corp <sup>**</sup>	7,13 %	01.10.2027	2.679.832	0,12
22.050.000	OneMain Finance Corp <sup>*</sup>	3,50 %	15.01.2027	18.284.301	0,80
2.415.000	OneMain Finance Corp <sup>*</sup>	3,88 %	15.09.2028	1.923.596	0,08
6.560.000	OneMain Finance Corp <sup>*</sup>	5,38 %	15.11.2029	5.376.317	0,23
6.230.000	OneMain Finance Corp <sup>*</sup>	6,63 %	15.01.2028	5.747.673	0,25
3.690.000	OneMain Finance Corp <sup>**</sup>	6,88 %	15.03.2025	3.553.120	0,15
9.995.000	OneMain Finance Corp <sup>**</sup>	7,13 %	15.03.2026	9.526.334	0,41
1.720.000	Open Text Corp <sup>**</sup>	3,88 %	15.02.2028	1.478.942	0,06
2.905.000	Open Text Corp <sup>**</sup>	3,88 %	01.12.2029	2.340.364	0,10
6.475.000	Open Text Holdings Inc <sup>**</sup>	4,13 %	01.12.2031	5.042.345	0,22
6.990.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV <sup>**</sup>	5,13 %	30.04.2031	6.064.770	0,26
360.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC <sup>**</sup>	4,00 %	15.10.2027	319.914	0,01
7.980.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc <sup>**</sup>	4,38 %	15.10.2028	7.139.506	0,31
3.840.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer <sup>**</sup>	4,88 %	15.05.2029	3.255.552	0,14
3.275.000	PDC Energy Inc <sup>**</sup>	5,75 %	15.05.2026	3.131.555	0,14

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.825.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp**	8,00 %	15.11.2029	1.188.057	0,05
7.891.000	Performance Food Group Inc**	5,50 %	15.10.2027	7.459.283	0,32
4.720.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	7,75 %	15.02.2029	4.441.839	0,19
8.320.000	Pilgrim's Pride Corp**	4,25 %	15.04.2031	7.088.640	0,31
3.050.000	PNC Financial Services Group Inc**	3,40 %	29.12.2049	2.424.750	0,11
13.580.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	12.611.203	0,55
9.275.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	8.947.592	0,39
10.456.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	9.538.172	0,42
6.560.000	Rackspace Technology Global Inc**	3,50 %	15.02.2028	3.820.347	0,17
25.520.000	Rackspace Technology Global Inc**	5,38 %	01.12.2028	11.164.402	0,49
3.420.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	6,50 %	15.09.2028	1.438.589	0,06
6.442.000	Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC**	4,88 %	01.11.2026	5.732.222	0,25
18.215.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	13.311.704	0,58
21.236.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75 %	15.01.2029	16.090.305	0,70
8.170.000	Resideo Funding Inc**	4,00 %	01.09.2029	6.617.863	0,29
5.103.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,50 %	15.02.2029	4.408.321	0,19
7.995.000	RLJ Lodging Trust LP**	4,00 %	15.09.2029	6.492.824	0,28
3.820.000	Rockcliff Energy II LLC**	5,50 %	15.10.2029	3.499.979	0,15
15.225.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	12.177.260	0,53
1.965.000	Ryan Specialty Group LLC**	4,38 %	01.02.2030	1.703.942	0,07
5.890.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc**	6,63 %	01.03.2030	4.982.940	0,22
8.250.000	SCIH Salt Holdings Inc**	6,63 %	01.05.2029	6.655.931	0,29
2.580.000	SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**	5,38 %	01.11.2026	2.189.775	0,10
1.005.000	Select Medical Corp**	6,25 %	15.08.2026	957.654	0,04
7.960.000	Sensata Technologies BV**	4,00 %	15.04.2029	6.876.246	0,30
4.180.000	Sensata Technologies BV**	5,88 %	01.09.2030	3.967.532	0,17
5.105.000	Service Properties Trust**	3,95 %	15.01.2028	3.632.574	0,16
4.149.000	Service Properties Trust**	4,35 %	01.10.2024	3.778.293	0,16
2.216.000	Service Properties Trust**	4,65 %	15.03.2024	2.120.052	0,09
4.503.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	15.02.2028	3.938.718	0,17
3.595.000	Sirius XM Radio Inc**	3,88 %	01.09.2031	2.811.629	0,12
2.920.000	Sirius XM Radio Inc**	4,00 %	15.07.2028	2.546.882	0,11
5.910.000	Sirius XM Radio Inc**	4,13 %	01.07.2030	4.890.318	0,21
12.010.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00 %	01.08.2027	11.127.999	0,48
10.115.000	Sirius XM Radio Inc**	5,50 %	01.07.2029	9.255.579	0,40
5.075.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	4.578.665	0,20
3.250.000	Six Flags Theme Parks Inc**	7,00 %	01.07.2025	3.277.436	0,14
8.430.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	8.395.016	0,37
4.205.000	Southwestern Energy Co*	4,75 %	01.02.2032	3.601.646	0,16
4.675.000	Spirit AeroSystems Inc**	9,38 %	30.11.2029	4.927.216	0,21

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
3.300.000	Sprint Capital Corp**	6,88 %	15.11.2028	3.432.644	0,15
2.090.000	Sprint Capital Corp**	8,75 %	15.03.2032	2.492.022	0,11
6.810.000	Sprint LLC**	7,13 %	15.06.2024	6.958.049	0,30
795.000	Sprint LLC**	7,63 %	15.02.2025	822.455	0,04
6.360.000	SPX FLOW Inc**	8,75 %	01.04.2030	5.024.146	0,22
3.090.000	SRS Distribution Inc**	6,13 %	01.07.2029	2.502.344	0,11
9.205.000	Standard Industries Inc**	4,38 %	15.07.2030	7.520.573	0,33
3.345.000	Starwood Property Trust Inc**	3,75 %	31.12.2024	3.144.870	0,14
8.945.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50 %	31.10.2026	7.269.512	0,32
4.775.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp*	5,75 %	15.04.2025	4.062.219	0,18
13.510.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	8,50 %	15.10.2026	12.886.378	0,56
7.015.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	6.275.900	0,27
8.165.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50 %	15.01.2028	7.253.949	0,32
1.720.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.03.2027	1.608.541	0,07
2.615.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	2.264.668	0,10
6.110.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.09.2031	5.261.221	0,23
5.685.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50 %	01.10.2025	5.745.119	0,25
8.752.000	Team Health Holdings Inc**	6,38 %	01.02.2025	5.057.081	0,22
2.715.000	Telecom Italia Capital SA**	6,38 %	15.11.2033	2.225.295	0,10
2.380.000	Telecom Italia Capital SA**	7,20 %	18.07.2036	1.936.273	0,08
3.000.000	Telecom Italia SpA*	5,30 %	30.05.2024	2.848.500	0,12
2.220.000	Tenet Healthcare Corp*	4,63 %	15.07.2024	2.168.312	0,09
3.665.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	3.289.081	0,14
3.005.000	Terex Corp**	5,00 %	15.05.2029	2.704.575	0,12
4.960.000	T-Mobile USA Inc**	3,38 %	15.04.2029	4.378.165	0,19
2.795.000	T-Mobile USA Inc**	4,75 %	01.02.2028	2.723.707	0,12
13.183.000	TMS International Corp**	6,25 %	15.04.2029	9.461.505	0,41
2.515.000	Toll Brothers Finance Corp*	3,80 %	01.11.2029	2.152.365	0,09
5.305.000	TransAlta Corp*	7,75 %	15.11.2029	5.425.033	0,24
8.190.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	8.094.914	0,35
3.300.000	TransDigm Inc*	6,38 %	15.06.2026	3.215.569	0,14
4.375.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	4.335.569	0,19
2.512.000	TreeHouse Foods Inc*	4,00 %	01.09.2028	2.139.219	0,09
1.865.000	Tri Pointe Homes Inc*	5,25 %	01.06.2027	1.667.935	0,07
2.470.000	Trident TPI Holdings Inc**	9,25 %	01.08.2024	2.364.683	0,10
3.815.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	3.506.312	0,15
8.415.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	7.734.268	0,34
4.380.000	Tronox Inc**	4,63 %	15.03.2029	3.649.088	0,16
2.355.000	Truist Financial Corp**	4,95 %	29.12.2049	2.257.503	0,10
7.025.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	6.523.598	0,28

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 86,24 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.560.000	United Airlines Inc**	4,63 %	15.04.2029	3.978.375	0,17
6.585.000	United Rentals North America Inc*	3,75 %	15.01.2032	5.380.801	0,23
2.450.000	United Rentals North America Inc*	4,00 %	15.07.2030	2.098.600	0,09
3.565.000	United Rentals North America Inc*	5,25 %	15.01.2030	3.355.931	0,15
14.640.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50 %	15.02.2029	9.726.377	0,42
4.525.000	Univar Solutions USA Inc**	5,13 %	01.12.2027	4.299.067	0,19
4.520.000	US Acute Care Solutions LLC**	6,38 %	01.03.2026	4.016.805	0,18
3.620.000	US Foods Inc**	4,75 %	15.02.2029	3.218.542	0,14
3.345.000	US Foods Inc**	6,25 %	15.04.2025	3.315.441	0,14
65.000	Verscend Escrow Corp**	9,75 %	15.08.2026	63.821	0,00
5.825.000	Vibrantz Technologies Inc**	9,00 %	15.02.2030	4.403.471	0,19
2.505.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,13 %	15.08.2030	2.196.497	0,10
1.895.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC*	5,00 %	15.07.2028	1.659.342	0,07
8.250.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	6.625.781	0,29
7.625.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	6.888.577	0,30
9.735.000	Vistra Corp**	7,00 %	29.12.2049	8.872.267	0,39
10.280.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38 %	01.05.2029	8.878.136	0,39
8.420.000	Vistra Operations Co LLC**	5,50 %	01.09.2026	8.125.698	0,35
6.700.000	Vistra Operations Co LLC**	5,63 %	15.02.2027	6.370.779	0,28
7.855.000	VM Consolidated Inc**	5,50 %	15.04.2029	6.928.581	0,30
8.235.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,75 %	15.07.2031	6.705.802	0,29
5.280.000	White Capital Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	4.571.107	0,20
2.790.000	WMG Acquisition Corp**	3,88 %	15.07.2030	2.408.117	0,11
1.320.000	WR Grace Holdings LLC**	4,88 %	15.06.2027	1.171.342	0,05
8.000.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	6.478.160	0,28
2.455.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc**	4,38 %	15.08.2028	2.206.554	0,10
3.600.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,25 %	15.05.2027	3.254.583	0,14
5.500.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,50 %	01.03.2025	5.232.733	0,23
2.585.000	Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp**	5,13 %	01.10.2029	2.219.908	0,10
4.005.000	XHR LP**	4,88 %	01.06.2029	3.285.807	0,14
1.065.000	XHR LP**	6,38 %	15.08.2025	1.025.640	0,04
4.755.000	Zayo Group Holdings Inc**	6,13 %	01.03.2028	2.706.682	0,12
3.790.000	Ziff Davis Inc**	4,63 %	15.10.2030	3.213.749	0,14
1.975.000	ZipRecruiter Inc**	5,00 %	15.01.2030	1.630.797	0,07
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>1.978.713.612</b>	<b>86,08</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>1.982.553.426</b>	<b>86,24</b>
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 3,99 % (31. Dezember 2021: 5,23 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
3.382.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/Aru Finance Corp	12,94 %	01.11.2025	3.584.920	0,16



## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 3,99 % (31. Dezember 2021: 5,23 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
3.008.041	Asurion LLC	7,38 %	03.11.2024	2.929.080	0,13
3.036.987	Cytera DC Holdings Inc	7,36 %	01.05.2024	2.603.275	0,11
3.892.519	Dealer Tire Financial LLC	8,82 %	14.12.2027	3.859.433	0,17
5.865.000	Entain Plc	0,00 %	31.10.2029	5.846.672	0,25
7.479.669	Gainwell Acquisition Corp	8,73 %	01.10.2027	7.040.238	0,31
4.712.021	Great Outdoors Group LLC	8,13 %	06.03.2028	4.538.265	0,20
3.005.459	Ineos US Finance LLC	0,00 %	01.04.2024	3.008.946	0,13
3.045.000	LifePoint Health Inc	8,16 %	16.11.2025	2.877.906	0,13
5.947.092	Lightstone Holdco LLC B Term Loan	10,07 %	01.02.2027	5.471.324	0,24
336.360	Lightstone Holdco LLC C Term Loan	10,07 %	01.02.2027	309.452	0,01
3.028.974	Mauser Packaging Solutions Holding Co	7,37 %	03.04.2024	2.963.351	0,13
14.575.000	Phoenix Newco Inc	10,88 %	15.11.2029	13.846.250	0,60
4.315.000	Prairie ECI Acquiror LP	9,13 %	11.03.2026	4.205.917	0,18
64.791	Service Logic Acquisition Inc	8,41 %	29.10.2027	61.552	0,00
5.850.189	Starwood Property Mortgage LLC	7,63 %	26.07.2026	5.791.687	0,25
8.648.078	Team Health Holdings Inc	9,57 %	02.03.2027	6.542.833	0,29
3.029.058	Trident TPI Holdings Inc	7,98 %	17.10.2024	2.999.236	0,13
5.860.235	US Silica Co	8,44 %	01.05.2025	5.816.284	0,25
3.029.621	Verscend Holding Corp	8,38 %	27.08.2025	3.016.367	0,13
4.484.376	WaterBridge Midstream Operating LLC	9,13 %	22.06.2026	4.322.513	0,19
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>				<b>91.635.501</b>	<b>3,99</b>

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Investmentfonds 0,80 % (31. Dezember 2021: 1,12 %)</b>			
<b>Britisches Pfund</b>			
21.329.208	NB Global Monthly Income Fund Ltd	18.294.706	0,80
<b>Investmentfonds insgesamt †</b>		<b>18.294.706</b>	<b>0,80</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>2.114.313.939</b>	<b>91,98</b>

Devisenterminkontrakte 2,42 % (31. Dezember 2021: 0,20 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht- realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
4.640.046 AUD	2.995.266 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	153.275	0,01
970.587 AUD	632.696 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	25.904	0,00
171.277.134 AUD	111.056.446 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	38	5.165.052	0,22
1.091.054 US\$	1.598.621 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	11	6.296	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CAD</i>						
82.970 CAD	60.237 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.002	0,00
13.848.301 CAD	10.133.864 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	87.371	0,00

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,42 % (31. Dezember 2021: 0,20 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CAD (Fortsetzung)</i>						
72.816 US\$	98.079 CAD	18.01.2023	UBS AG	1	426	0,00
1.553.135 US\$	2.076.378 CAD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	20.590	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
212.166 CHF	227.134 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	2.551	0,00
14.745.533 CHF	15.119.602 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	51	843.485	0,04
97.125 US\$	89.508 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	226	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CNY</i>						
38.549.055 CNY	5.464.699 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	113.531	0,01
752.863 CNY	105.779 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	3.163	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
1.827.493 €	1.832.085 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	120.279	0,01
289.399.649 €	288.015.938 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	72	21.158.180	0,92
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
966.901 £	1.126.949 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	36.597	0,00
114.940.204 £	129.440.025 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	8.876.335	0,39
124.183.195 £	140.380.330 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	25	9.058.830	0,39
1.274.553 US\$	1.056.006 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	3.780	0,00
5.457.534 US\$	4.484.218 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	31	61.326	0,00
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
835.272 HKD	106.509 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	547	0,00
787.241 HKD	100.577 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	324	0,00
58.367.956 HKD	7.447.996 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	33.017	0,00
37.253 US\$	290.292 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	46	0,00
193.479 US\$	1.506.372 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	408	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
104.195.087 SEK	9.510.741 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	497.867	0,02
3.532.178 SEK	325.597 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	27	13.691	0,00
39.212 US\$	405.211 SEK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	289	0,00
169.067 US\$	1.748.987 SEK	18.01.2023	Westpac Banking Corp	20	1.066	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
280.544 SGD	208.349 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	893	0,00
546.247 SGD	387.583 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	19.830	0,00
29.557.215 SGD	20.782.800 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	10	1.262.205	0,06
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
1.078.349 US\$	18.283.542 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	5.154	0,00
430.960 US\$	7.324.500 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	1.031	0,00
2.510.102.437 ZAR	139.525.353 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	7.810.975	0,34
26.022.152 ZAR	1.434.249 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	93.183	0,00
86.857.514 ZAR	4.869.488 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	45	228.819	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>55.707.544</b>	<b>2,42</b>

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert % des Netto- US\$ vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>2.170.021.483 94,40</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,09 %) (31. Dezember 2021: (0,81 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.089.080 €	1.314.551 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(3.978)	(0,00)
28.176.418 US\$	25.120.240 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(2.052.692)	(0,09)
3.583.681 US\$	3.602.175 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(264.627)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
1.450.298 AUD	996.587 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(12.475)	(0,00)
1.185.166 AUD	807.130 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(2.926)	(0,00)
5.130.303 US\$	7.883.826 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	(219.331)	(0,01)
1.128.077 US\$	1.737.454 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(50.887)	(0,00)
14.869.843 US\$	22.874.034 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	66	(651.520)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen CAD</i>						
220.971 CAD	165.907 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(2.811)	(0,00)
99.682 CAD	73.841 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(267)	(0,00)
63.027 US\$	86.059 CAD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(492)	(0,00)
4.010.510 US\$	5.480.921 CAD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(34.878)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
121.503 CHF	132.050 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(514)	(0,00)
127.958 CHF	138.793 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(270)	(0,00)
4.429.171 US\$	4.298.417 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	30	(224.171)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen CNY</i>						
3.477.356 US\$	24.526.744 CNY	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	(71.780)	(0,00)
10.045 US\$	72.407 CNY	18.01.2023	UBS AG	1	(433)	(0,00)
55.874 US\$	399.259 CNY	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(1.902)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
1.315.044 €	1.405.831 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(931)	(0,00)
1.510.940 US\$	1.465.873 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(55.095)	(0,00)
3.633.906 US\$	3.536.941 €	18.01.2023	UBS AG	4	(144.712)	(0,01)
170.274.683 US\$	171.123.333 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	42	(12.541.384)	(0,55)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
3.655.005 €	4.513.321 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	13	(114.974)	(0,01)
4.123.777 US\$	3.671.673 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(294.628)	(0,01)
46.936.274 US\$	41.678.491 €	18.01.2023	UBS AG	1	(3.218.650)	(0,14)
57.076.396 US\$	50.455.468 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	44	(3.640.534)	(0,16)
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
280.610 HKD	36.035 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(69)	(0,00)
427.494 HKD	54.984 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(192)	(0,00)

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,09 %) (31. Dezember 2021: (0,81 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen HKD (Fortsetzung)</i>						
27.974 US\$	219.374 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(143)	(0,00)
69.550 US\$	545.149 HKD	18.01.2023	UBS AG	1	(322)	(0,00)
2.491.500 US\$	19.525.980 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	(11.142)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
1.108.454 SEK	107.749 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(1.275)	(0,00)
2.132.379 SEK	207.891 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	12	(3.061)	(0,00)
80.428 US\$	907.780 SEK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(6.770)	(0,00)
1.915.012 US\$	20.979.950 SEK	18.01.2023	UBS AG	2	(100.247)	(0,00)
734.847 US\$	7.944.081 SEK	18.01.2023	Westpac Banking Corp	35	(28.232)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
383.778 US\$	540.084 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(19.040)	(0,00)
100.640 US\$	143.035 SGD	18.01.2023	UBS AG	1	(6.041)	(0,00)
3.102.281 US\$	4.371.399 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	(158.089)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
15.585.308 US\$	281.919.203 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(962.599)	(0,04)
2.323.463 US\$	40.265.043 ZAR	18.01.2023	UBS AG	2	(39.989)	(0,00)
6.486.645 US\$	114.745.326 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	68	(248.604)	(0,01)
68.921 ZAR	4.075 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(29)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(25.192.706)</b>	<b>(1,09)</b>

### Total Return Swap-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
USD 16.000.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup>	(404.963)	(0,02)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>(404.963)</b>	<b>(0,02)</b>

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die JPMorgan Chase Bank.

	Zeitwert % des Nettovermögens US\$	US\$	vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(25.597.669)</b>		<b>(1,11)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>2.144.423.814</b>		<b>93,29</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>154.327.898</b>		<b>6,71</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>2.298.751.712</b>		<b>100,00</b>

<sup>∞</sup> Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2022 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	244.957.273	10,42
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.759.426.459	74,81
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	91.635.501	3,90
μ Investmentfonds	18.294.706	0,78
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	30.109.875	1,28
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>2.144.423.814</b>	<b>91,19</b>

# InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 94,06 % (31. Dezember 2021: 96,46 %)</b>			
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
9.475	Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd Class A*	378.611	2,57
8.493	Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A*	324.666	2,20
87.300	Hongfa Technology Co Ltd Class A*	421.557	2,86
86.800	Longshine Technology Group Co Ltd Class A*	275.749	1,87
86.900	Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A*	354.566	2,40
46.600	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A*	428.091	2,90
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>2.183.240</b>	<b>14,80</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
9.500	Meituan Class B*	212.641	1,44
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>212.641</b>	<b>1,44</b>
<b>Indische Rupie</b>			
21.967	Bharti Airtel Ltd*	214.652	1,46
920	Tata Elxsi Ltd*	69.937	0,47
20.727	Tech Mahindra Ltd*	254.546	1,73
<b>Indische Rupie insgesamt</b>		<b>539.135</b>	<b>3,66</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
43.700	CyberAgent Inc*	386.840	2,62
12.900	Dexerials Corp*	249.308	1,69
1.000	Disco Corp*	286.104	1,94
5.300	Hamamatsu Photonics KK*	253.863	1,72
19.100	Harmonic Drive Systems Inc*	537.773	3,65
1.200	Jeol Ltd*	32.650	0,22
16.100	JMDC Inc*	461.238	3,13
2.900	Rohm Co Ltd*	209.459	1,42
57.100	Sansan Inc*	552.197	3,75
700	SMC Corp*	294.865	2,00
5.700	Socionext Inc*	250.559	1,70
8.900	Square Enix Holdings Co Ltd*	413.483	2,80
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>3.928.339</b>	<b>26,64</b>
<b>Malaysischer Ringgit</b>			
539.900	Inari Amertron Bhd*	319.895	2,17
<b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>		<b>319.895</b>	<b>2,17</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
57.000	Accton Technology Corp*	434.888	2,95
46.000	Chroma ATE Inc*	270.892	1,84

## InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 94,06 % (31. Dezember 2021: 96,46 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung)</b>			
83.000	E Ink Holdings Inc*	434.774	2,95
55.000	Elite Material Co Ltd*	305.998	2,07
12.000	eMemory Technology Inc*	521.222	3,53
29.499	Jentech Precision Industrial Co Ltd*	361.353	2,45
3.000	MediaTek Inc*	61.004	0,41
23.000	Silergy Corp*	326.642	2,21
26.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*	379.399	2,57
72.000	Unimicron Technology Corp*	281.108	1,91
29.000	Yageo Corp*	425.534	2,89
<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>		<b>3.802.814</b>	<b>25,78</b>
<b>Singapur-Dollar</b>			
198.200	AEM Holdings Ltd**	505.401	3,43
<b>Singapur-Dollar insgesamt</b>		<b>505.401</b>	<b>3,43</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>			
683	LG Innotek Co Ltd*	136.384	0,93
6.395	SK Hynix Inc*	379.300	2,57
<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>		<b>515.684</b>	<b>3,50</b>
<b>US-Dollar</b>			
3.782	Fabrinet*	484.928	3,29
9.434	Kanzhun Ltd ADR*	192.171	1,30
8.779	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR*	305.685	2,07
10.064	Rambus Inc*	360.492	2,44
2.481	Sea Ltd ADR*	129.086	0,88
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>1.472.362</b>	<b>9,98</b>
<b>Vietnamesischer Dong</b>			
120.480	FPT Corp*	392.997	2,66
<b>Vietnamesischer Dong</b>		<b>392.997</b>	<b>2,66</b>
<b>Aktien insgesamt</b>		<b>13.872.508</b>	<b>94,06</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>13.872.508</b>	<b>94,06</b>

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2021: 0,15 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
67.321 CHF	72.136 US\$	18.01.2023	UBS AG	5	744	0,00
587.424 CHF	603.209 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	32.722	0,22
12.214 US\$	11.256 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	28	0,00

## InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2021: 0,15 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
50.673 €	49.900 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	4.236	0,03
551.162 €	572.548 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	4	16.275	0,11
80.190 €	85.333 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	336	0,00
4.928.442 €	4.920.784 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	344.415	2,34
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
60.155 SGD	43.128 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	1.738	0,01
1.349.153 SGD	953.410 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	52.845	0,36
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>453.339</b>	<b>3,07</b>
					<b>Zeitwert % des Netto-</b>	
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>14.325.847</b>	<b>97,13</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,53 %) (31. Dezember 2021: (0,56 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
4.071 CHF	4.421 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(13)	(0,00)
3.888 US\$	3.680 CHF	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(97)	(0,00)
37.719 US\$	35.525 CHF	18.01.2023	UBS AG	6	(739)	(0,00)
144.228 US\$	138.587 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	17	(5.803)	(0,04)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
36.644 €	39.288 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(140)	(0,00)
261.740 US\$	260.513 €	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(16.573)	(0,11)
68.884 US\$	66.731 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(2.406)	(0,02)
348.680 US\$	332.883 €	18.01.2023	UBS AG	6	(6.949)	(0,05)
771.901 US\$	757.193 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	(37.031)	(0,25)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
9.285 SGD	6.937 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(12)	(0,00)
12.584 US\$	17.880 SGD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(752)	(0,00)
36.139 US\$	51.519 SGD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(2.286)	(0,02)
21.847 US\$	31.159 SGD	18.01.2023	UBS AG	2	(1.393)	(0,01)
182.385 US\$	250.618 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	19	(4.538)	(0,03)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(78.732)</b>	<b>(0,53)</b>



## InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(78.732)</b>	<b>(0,53)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>14.247.115</b>	<b>96,60</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>501.878</b>	<b>3,40</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>14.748.993</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	13.367.107	88,92
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	505.401	3,36
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	374.607	2,49
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>14.247.115</b>	<b>94,77</b>

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert JPY	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 98,37 % (31. Dezember 2021: 110,65 %)</b>			
<b>Japanischer Yen</b>			
630.000	Amada Co Ltd	651.420.000	3,17
174.000	Appier Group Inc	236.292.000	1,15
83.900	As One Corp	483.264.000	2,35
91.000	Asahi Intecc Co Ltd	196.924.000	0,96
40.000	BayCurrent Consulting Inc	164.600.000	0,80
390.000	BeNext-Yumeshin Group Co	663.390.000	3,23
98.000	BML Inc	328.790.000	1,60
71.000	Comture Corp	170.613.000	0,83
440.000	Concordia Financial Group Ltd	242.000.000	1,18
110.000	Daiei Kankyo Co Ltd	209.440.000	1,02
72.000	Daiseki Co Ltd	326.880.000	1,59
630.000	Daiwa Industries Ltd	710.010.000	3,46
244.500	Direct Marketing MiX Inc	379.464.000	1,85
110.000	eGuarantee Inc	268.730.000	1,31
15.000	eWeLL Co Ltd	54.525.000	0,27
120.000	ExaWizards Inc	52.440.000	0,25
30.000	FP Partner Inc	124.500.000	0,61
17.000	Fujimi Inc	106.250.000	0,52
3.000	GMO Financial Gate Inc	45.720.000	0,22
56.000	Heiwa Real Estate Co Ltd	205.240.000	1,00
115.000	Hokkoku Financial Holdings Inc	522.100.000	2,54
2.700	Inforich Inc	30.969.000	0,15
80.000	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	132.320.000	0,64
12.000	JMDC Inc	45.360.000	0,22
75.000	JSB Co Ltd	306.375.000	1,49
72.000	JSR Corp	186.336.000	0,91
67.000	Justsystems Corp	188.739.000	0,92
125.000	Kansai Paint Co Ltd	202.375.000	0,98
23.000	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	82.340.000	0,40
30.000	Kohoku Kogyo Co Ltd	186.600.000	0,91
38.000	MEC Co Ltd	78.964.000	0,38
110.000	Menicon Co Ltd	305.580.000	1,49
145.000	MISUMI Group Inc	417.455.000	2,03
433.800	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	678.897.000	3,30
100.000	Nakanishi Inc	255.700.000	1,24
20.000	NEC Networks & System Integration Corp	33.040.000	0,16
123.000	NGK Spark Plug Co Ltd	299.997.000	1,46
154.000	Nifco Inc	477.400.000	2,32
380.000	Okinawa Cellular Telephone Co	1.104.280.000	5,38

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert JPY	% des Nettovermögens
<b>Aktien 98,37 % (31. Dezember 2021: 110,65 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japanischer Yen (Fortsetzung)</b>			
15.000	Otsuka Corp	62.325.000	0,30
173.000	Pilot Corp	831.265.000	4,05
91.000	PR Times Inc	214.942.000	1,05
200.000	Resorttrust Inc	469.800.000	2,29
1.030.000	Ricoh Co Ltd	1.037.210.000	5,05
44.500	Sakai Moving Service Co Ltd	192.462.500	0,94
16.000	SB Technology Corp	29.984.000	0,15
52.000	SHO-BOND Holdings Co Ltd	292.240.000	1,42
200.000	Shoei Co Ltd	1.026.000.000	4,99
96.000	Snow Peak Inc	225.696.000	1,10
21.600	St Cousair Co Ltd	63.244.800	0,31
120.000	TKC Corp	432.600.000	2,11
74.000	TKP Corp	212.750.000	1,04
45.000	Tokyo Century Corp	201.600.000	0,98
1.420.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	891.760.000	4,34
144.000	Transaction Co Ltd	174.816.000	0,85
275.000	USS Co Ltd	576.125.000	2,80
68.000	WingArc1st Inc	137.836.000	0,67
146.000	Yamaha Corp	718.320.000	3,50
240.000	Yamanashi Chuo Bank Ltd	266.400.000	1,30
173.000	Yokogawa Electric Corp	364.165.000	1,77
70.000	Zenkoku Hosho Co Ltd	353.500.000	1,72
91.000	Zuken Inc	277.095.000	1,35
	<b>Aktien insgesamt *</b>	<b>20.207.455.300</b>	<b>98,37</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>20.207.455.300</b>	<b>98,37</b>

### Devisenterminkontrakte 0,22 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn JPY	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
251.081.814 ¥	1.715.604 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	9.719.405	0,05
942.712.851 ¥	6.596.403 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	8	14.687.667	0,07
690.923.942 ¥	4.770.530 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	19.774.542	0,10
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
941.565 ¥	5.756 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	29.362	0,00
430.082 ¥	2.591 £	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	19.464	0,00
9.599.563 ¥	58.675 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	300.904	0,00
	<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>44.531.344</b>	<b>0,22</b>

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert% des Netto- JPY vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>20.251.986.644 98,59</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust JPY	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
4.133.432 €	597.525.470 ¥	18.01.2023	Standard Chartered Bank	5	(16.007.181)	(0,08)
33.991.222 €	4.832.347.993 ¥	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(50.240.169)	(0,24)
38.406.252 €	5.474.155.453 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	10	(70.912.361)	(0,35)
454.665.190 ¥	3.250.161 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	4	(2.588.750)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
152.355 £	24.555.887 ¥	18.01.2023	Standard Chartered Bank	3	(410.815)	(0,00)
6.388 £	1.075.746 ¥	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(63.384)	(0,00)
231.973 £	37.755.205 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	(992.432)	(0,01)
312.046 ¥	1.970 £	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(157)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(141.215.249)</b>	<b>(0,69)</b>

	Zeitwert% des Netto- JPY vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(141.215.249) (0,69)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>20.110.771.395 97,90</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>431.896.190 2,10</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>20.542.667.585 100,00</b>

Portfolioanalyse	JPY	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	20.207.455.300	97,61
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(96.683.905)	(0,47)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>20.110.771.395</b>	<b>97,14</b>

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Schatzwechsel 13,93 % (31. Dezember 2021: 4,95 %)</b>					
<b>Euro</b>					
1.200.000	European Stability Mechanism Treasury Bill	0,00 %	20.04.2023	1.192.276	3,78
3.250.000	Finland T-Bill	0,00 %	14.08.2023	3.197.707	10,15
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>4.389.983</b>	<b>13,93</b>
<b>Unternehmensanleihen 79,24 % (31. Dezember 2021: 96,01 %)</b>					
<b>Euro</b>					
600.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd	0,13 %	22.09.2023	587.825	1,87
1.000.000	Arkea Home Loans SFH SA	2,38 %	11.07.2023	998.265	3,17
1.000.000	AXA Bank Europe SCF	0,38 %	23.03.2023	996.281	3,16
1.000.000	Bank of Montreal	0,20 %	26.01.2023	998.945	3,17
1.500.000	Bank of Nova Scotia	0,38 %	23.10.2023	1.467.999	4,66
1.200.000	Belfius Bank SA	0,38 %	24.10.2023	1.174.814	3,73
1.000.000	BPCE SFH SA	2,38 %	29.11.2023	993.376	3,15
1.000.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	3,90 %	20.10.2023	1.006.602	3,19
1.500.000	Cie de Financement Foncier SA	0,33 %	12.09.2023	1.473.776	4,68
1.500.000	Commerzbank AG	0,25 %	13.09.2023	1.473.043	4,68
300.000	Credit Agricole Public Sector SCF SA	1,88 %	07.06.2023	299.086	0,95
1.000.000	Dexia Credit Local SA	0,25 %	01.06.2023	991.008	3,15
450.000	Dexia Credit Local SA	0,75 %	25.01.2023	449.712	1,43
1.000.000	DNB Boligkreditt AS	0,25 %	18.04.2023	994.316	3,16
500.000	DNB Boligkreditt AS	0,38 %	14.11.2023	488.583	1,55
1.500.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec	0,38 %	30.05.2023	1.487.243	4,72
1.000.000	ING Bank NV	1,88 %	22.05.2023	997.726	3,17
500.000	ING-DiBa AG	0,25 %	09.10.2023	489.805	1,55
1.500.000	Jyske Realkredit A/S	0,25 %	01.07.2023	1.481.917	4,70
1.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	0,13 %	07.06.2023	990.892	3,14
800.000	National Australia Bank Ltd	1,88 %	13.01.2023	799.963	2,54
1.000.000	National Bank of Canada	0,00 %	29.09.2023	978.089	3,10
1.000.000	OP Mortgage Bank	0,25 %	11.05.2023	992.380	3,15
1.500.000	Santander UK Plc	0,38 %	20.09.2023	1.472.097	4,67
900.000	Societe Generale SFH SA	0,25 %	11.09.2023	883.778	2,80
<b>Unternehmensanleihen insgesamt *</b>				<b>24.967.521</b>	<b>79,24</b>
<b>Staatsanleihen 8,82 % (31. Dezember 2021: 0,45 %)</b>					
<b>Euro</b>					
1.000.000	BNG Bank NV	0,05 %	11.07.2023	986.703	3,13
800.000	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	0,13 %	01.06.2023	792.596	2,52

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 8,82 % (31. Dezember 2021: 0,45 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
1.000.000	UNEDIC ASSEO	2,25 %	05.04.2023	999.340	3,17
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>2.778.639</b>	<b>8,82</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>32.136.143</b>	<b>101,99</b>

Devisenterminkontrakte 11,48 % (31. Dezember 2021: 4,31 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
8.289.169 AUD	5.285.400 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	4	317.586	1,01
4.289.180 AUD	2.793.660 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	109.329	0,35
1.796.467 AUD	1.204.495 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	13.585	0,04
3.620.394 AUD	2.448.382 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	7.738	0,02
6.894.336 BRL	1.283.145 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	17.605	0,06
1.936.295 CAD	1.405.654 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	21.995	0,07
1.678.661 CAD	1.228.803 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	9.541	0,03
3.794.661 CHF	3.823.608 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	3	266.193	0,84
3.048.037 CHF	3.266.900 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	30.719	0,10
1.128.130 CHF	1.219.020 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	2.116	0,01
563.603.542 CLP	568.579 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	86.149	0,27
13.229.759 CZK	555.939 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	26.314	0,08
43.013.428 CZK	1.874.593 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	22.756	0,07
6.073.028 €	6.233.161 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	5	238.537	0,76
1.379.771 €	1.404.621 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	64.989	0,21
1.179.232 €	1.243.759 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	15.023	0,05
2.618.070 €	2.639.264 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	147.612	0,47
4.703.635 €	4.827.624 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	184.784	0,59
182.692 €	180.000 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	14.205	0,04
358.642 £	423.551 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	7.517	0,02
1.198.400 £	1.383.408 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	54.963	0,17
80.698 HUF	182 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	30	0,00
505.318.044 ¥	3.593.979 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	3	227.651	0,72
868.414.387 ¥	6.188.231 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	4	380.185	1,21
26.137.818 MXN	1.285.074 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	49.188	0,16
3.170.774 NOK	297.563 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	22.938	0,07
9.529.647 NOK	938.545 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	27.538	0,09
1.848.381 NZD	1.076.146 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	87.152	0,28
2.300.116 NZD	1.328.559 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	118.366	0,37
9.556.973 NZD	5.413.681 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	591.474	1,88
598 PLN	119 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	16	0,00
13.300.729 SEK	1.276.079 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.443	0,00

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 11,48 % (31. Dezember 2021: 4,31 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens	
31.888.426 SEK	2.917.914 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	135.889	0,43	
12.340.934 SEK	1.119.931 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	61.306	0,19	
1.428.898 US\$	1.905.964 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	1	20.718	0,07	
4.250.525 US\$	3.486.820 £	18.01.2023	BNP Paribas	3	51.078	0,16	
1.229.697 US\$	1.019.269 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2.932	0,01	
1.213.756 US\$	6.415.914 BRL	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2.013	0,01	
1.414.522 US\$	1.899.065 CAD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	12.028	0,04	
1.269.138 US\$	1.991.579 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	8.706	0,03	
1.212.802 US\$	11.926.036 NOK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.335	0,00	
1.228.948 US\$	1.930.903 NZD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	7.014	0,02	
1.221.930 US\$	11.971.514 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	5.554	0,02	
625.716 US\$	985.061 NZD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	2.418	0,01	
1.229.921 US\$	1.804.309 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	5.234	0,02	
2.440.769 US\$	3.845.045 NZD	18.01.2023	UBS AG	1	7.921	0,02	
1.555.106 ZAR	85.821 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	5.110	0,02	
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>							
955 €	834 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	15	0,00	
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>							
9.638.983 €	105.839.149 SEK	18.01.2023	Westpac Banking Corp	42	122.699	0,39	
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>3.617.207</b>	<b>11,48</b>	
					<b>Zeitwert % des Nettovermögens</b>		
					<b>EUR</b>		
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>35.753.350</b>	<b>113,47</b>	

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (14,06 %) (31. Dezember 2021: (6,09 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
4.342.652 BRL	829.292 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(8.620)	(0,03)
1.869.269 CAD	1.402.986 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(21.816)	(0,07)
5.201.226 CAD	3.869.043 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(28.169)	(0,09)
865.577 CAD	642.100 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(3.024)	(0,01)
3.246.820 CAD	2.398.269 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(1.720)	(0,01)
1.728.336 CAD	1.301.623 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(24.303)	(0,08)
1.378.033 CHF	1.496.268 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(4.165)	(0,01)
1.149.867 €	1.234.926 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(6.074)	(0,02)
960.583 £	1.157.584 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(1.536)	(0,00)
2.675.777 NOK	272.804 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(949)	(0,00)

## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (14,06 %) (31. Dezember 2021: (6,09 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
3.593.611 SEK	348.374 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(2.981)	(0,01)
24.869.736 SEK	2.422.772 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(31.707)	(0,10)
5.504.655 US\$	5.476.674 €	18.01.2023	BNP Paribas	4	(324.095)	(1,03)
3.943.729 US\$	3.796.940 CHF	18.01.2023	BNP Paribas	3	(156.065)	(0,49)
1.443.776 US\$	1.965.225 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(6.297)	(0,02)
296.876 US\$	6.851.866 CZK	18.01.2023	BNP Paribas	1	(5.253)	(0,02)
1.024.198 US\$	20.176.698 MXN	18.01.2023	BNP Paribas	1	(7.826)	(0,02)
1.344.715 US\$	2.129.290 AUD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(93.729)	(0,30)
2.059.853 US\$	3.494.026 NZD	18.01.2023	BNP Paribas	2	(140.785)	(0,45)
1.523.258 US\$	1.358.181 £	18.01.2023	BNP Paribas	1	(104.036)	(0,33)
3.875.099 US\$	560.336.898 ¥	18.01.2023	BNP Paribas	3	(355.580)	(1,13)
1.506.212 US\$	15.781.399 SEK	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(9.073)	(0,03)
2.756.597 US\$	4.692.240 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(198.095)	(0,63)
1.464.701 US\$	1.455.736 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(104.122)	(0,33)
1.581.545 US\$	214.426.190 ¥	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(43.735)	(0,14)
2.827.420 US\$	2.762.383 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(115.804)	(0,37)
575.396 US\$	808.781.692 KRW	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(63.156)	(0,20)
2.987.477 US\$	75.176.385 CZK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(310.127)	(0,98)
472.179 US\$	448.943.022 CLP	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(50.582)	(0,16)
2.611.870 US\$	2.364.006 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(218.022)	(0,69)
1.026.470 US\$	147.007.785 ¥	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(84.102)	(0,27)
690.874 US\$	7.368.486 SEK	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(15.834)	(0,05)
3.761 US\$	77.464 TRY	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(310)	(0,00)
3.986.613 US\$	3.747.872 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	3	(16.241)	(0,05)
4.953.987 US\$	7.674.617 AUD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(237.464)	(0,75)
754.243 US\$	1.039.864 CAD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(12.417)	(0,04)
571.265 US\$	936.847 NZD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(20.001)	(0,06)
3.661.858 US\$	3.445.499 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(17.852)	(0,06)
1.215.162 US\$	1.804.182 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(8.501)	(0,03)
1.297.167 US\$	13.897.064 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(107.097)	(0,34)
1.597.628 US\$	16.653.310 SEK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(1.900)	(0,01)
4.403.163 US\$	6.083.701 CAD	18.01.2023	UBS AG	1	(81.555)	(0,26)
75 US\$	534 CNY	18.01.2023	UBS AG	1	(2)	(0,00)
1.233.580 US\$	13.234.696 NOK	18.01.2023	UBS AG	1	(103.641)	(0,33)
1.450.921 US\$	1.354.320 CHF	18.01.2023	UBS AG	1	(14.253)	(0,04)
4.656.538 US\$	4.404.147 €	18.01.2023	UBS AG	4	(45.440)	(0,14)
353.650 US\$	1.874.294 BRL	18.01.2023	UBS AG	1	(279)	(0,00)
1.305.222 US\$	174.335.882 ¥	18.01.2023	UBS AG	1	(17.425)	(0,06)



## Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (14,06 %) (31. Dezember 2021: (6,09 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
160.487 £	181.573 €	18.01.2023	Deutsche Bank AG	1	(799)	(0,00)
899 £	1.022 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(9)	(0,00)
2.160 £	2.465 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(32)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
39.189 €	437.641 SEK	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(161)	(0,00)
350.989.581 SEK	32.259.783 €	18.01.2023	Deutsche Bank AG	1	(701.364)	(2,23)
18.015.430 SEK	1.650.208 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	71	(30.393)	(0,10)
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
42.989 US\$	41.511 €	18.01.2023	UBS AG	1	(1.272)	(0,00)
6.955.277 US\$	6.979.206 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(468.786)	(1,49)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(4.428.576)</b>	<b>(14,06)</b>

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(4.428.576)</b>	<b>(14,06)</b>

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>31.324.774</b>	<b>99,41</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>185.382</b>	<b>0,59</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>31.510.156</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	EUR	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	27.746.160	76,95
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	4.389.983	12,17
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(811.369)	(2,25)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>31.324.774</b>	<b>86,87</b>

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 25,06 % (31. Dezember 2021: 27,38 %)</b>			
<b>Australischer Dollar</b>			
463	ANZ Group Holdings Ltd	7.429	0,07
330	Coles Group Ltd	3.742	0,03
51	Commonwealth Bank of Australia	3.548	0,03
520	Fortescue Metals Group Ltd	7.233	0,06
406	National Australia Bank Ltd	8.276	0,07
620	Telstra Group Ltd	1.678	0,02
275	Transurban Group	2.421	0,02
128	Wesfarmers Ltd	3.985	0,04
164	Westpac Banking Corp	2.597	0,02
97	Woodside Energy Group Ltd	2.331	0,02
	<b>Australischer Dollar insgesamt</b>	<b>43.240</b>	<b>0,38</b>
<b>Brasilianischer Real</b>			
770	Banco Bradesco SA - Preferred Shares	2.196	0,02
330	BB Seguridade Participacoes SA	2.101	0,02
166	Energisa SA	1.391	0,01
222	Engie Brasil Energia SA	1.594	0,01
677	Equatorial Energia SA	3.468	0,03
2.843	TIM SA	6.657	0,06
	<b>Brasilianischer Real insgesamt</b>	<b>17.407</b>	<b>0,15</b>
<b>Euro</b>			
25	Allianz SE	5.323	0,05
332	Assicurazioni Generali SpA	5.886	0,05
377	AXA SA	10.470	0,09
219	BASF SE	10.751	0,09
60	Bayer AG	3.079	0,03
60	Bayerische Motoren Werke AG	5.296	0,05
45	Bayerische Motoren Werke AG - Preferred Shares	3.786	0,03
185	BNP Paribas SA	10.502	0,09
274	Credit Agricole SA	2.874	0,03
26	CRH Plc	1.031	0,01
71	Danone SA	3.731	0,03
208	Deutsche Post AG	7.762	0,07
150	Deutsche Telekom AG	2.976	0,03
94	Endesa SA	1.766	0,02
421	Enel SpA	2.257	0,02
140	Eni SpA	1.985	0,02
563	Iberdrola SA	6.553	0,06

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 25,06 % (31. Dezember 2021: 27,38 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Euro (Fortsetzung)</b>			
717	Intesa Sanpaolo SpA	1.584	0,01
263	Koninklijke Ahold Delhaize NV	7.539	0,07
142	Mercedes-Benz Group AG	9.258	0,08
4	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1.290	0,01
31	Naturgy Energy Group SA	803	0,01
258	Orange SA	2.552	0,02
69	Sampo Oyj Class A	3.593	0,03
128	Sanofi	12.306	0,11
1.050	Snam SpA	5.076	0,04
989	Telefonica SA	3.570	0,03
240	TotalEnergies SE	15.021	0,13
32	Vinci SA	3.180	0,03
	<b>Euro insgesamt</b>	<b>151.800</b>	<b>1,34</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
580	Alibaba Group Holding Ltd	6.409	0,06
9.000	Bank of China Ltd - H Shares	3.275	0,03
9.000	Bank of Communications Co Ltd - H Shares	5.177	0,05
500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	1.704	0,01
5.000	China CITIC Bank Corp Ltd - H Shares	2.216	0,02
6.000	China Communications Services Corp Ltd - H Shares	2.191	0,02
9.000	China Construction Bank Corp - H Shares	5.639	0,05
4.000	China Galaxy Securities Co Ltd - H Shares	1.953	0,02
3.000	China Hongqiao Group Ltd	2.833	0,02
2.000	China Life Insurance Co Ltd - H Shares	3.434	0,03
2.000	China National Building Material Co Ltd - H Shares	1.643	0,01
6.000	China Petroleum & Chemical Corp - H Shares	2.898	0,02
3.000	CITIC Ltd	3.167	0,03
471	CK Asset Holdings Ltd	2.900	0,03
183	CK Hutchison Holdings Ltd	1.098	0,01
5.000	CRRG Corp Ltd - H Shares	2.018	0,02
2.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	2.101	0,02
400	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd - H Shares	1.678	0,01
1.000	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares	3.408	0,03
6.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares	3.090	0,03
94	JD.com Inc Class A	2.652	0,02
2.000	Jiangsu Expressway Co Ltd - H Shares	1.827	0,02
200	Meituan Class B	4.477	0,04
250	NetEase Inc	3.667	0,03
6.000	People's Insurance Co Group of China Ltd - H Shares	1.991	0,02

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 25,06 % (31. Dezember 2021: 27,38 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong-Dollar (Fortsetzung)</b>			
2.000	PICC Property & Casualty Co Ltd - H Shares	1.899	0,02
1.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares	6.618	0,06
500	Sun Hung Kai Properties Ltd	6.842	0,06
200	Tencent Holdings Ltd	8.559	0,07
2.000	Zhejiang Expressway Co Ltd - H Shares	1.540	0,01
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>98.904</b>	<b>0,87</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
100	Bridgestone Corp	3.555	0,03
353	Canon Inc	7.639	0,07
300	Honda Motor Co Ltd	6.894	0,06
87	Japan Post Holdings Co Ltd	731	0,01
110	KDDI Corp	3.320	0,03
300	Kirin Holdings Co Ltd	4.572	0,04
800	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	5.390	0,05
541	Mitsui & Co Ltd	15.798	0,14
729	Mizuho Financial Group Inc	10.254	0,09
308	Nippon Telegraph & Telephone Corp	8.782	0,08
60	ORIX Corp	963	0,01
271	Sekisui House Ltd	4.793	0,04
96	Sompo Holdings Inc	4.264	0,04
209	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	8.389	0,07
413	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	12.868	0,11
405	Tokio Marine Holdings Inc	8.679	0,07
88	Toyota Motor Corp	1.209	0,01
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>108.100</b>	<b>0,95</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
2.264	Cathay Financial Holding Co Ltd	2.946	0,03
1.390	Fubon Financial Holding Co Ltd	2.546	0,02
2.294	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	7.456	0,06
236	MediaTek Inc	4.799	0,04
2.514	Mega Financial Holding Co Ltd	2.483	0,02
1.548	Synnex Technology International Corp	2.982	0,03
<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>		<b>23.212</b>	<b>0,20</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
158	Anglo American Plc	6.156	0,05
1.026	Aviva Plc	5.415	0,05
971	BAE Systems Plc	9.979	0,09

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 25,06 % (31. Dezember 2021: 27,38 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>			
1.185	BP Plc	6.803	0,06
445	GSK Plc	7.653	0,07
1.592	Legal & General Group Plc	4.749	0,04
491	National Grid Plc	5.853	0,05
22	Reckitt Benckiser Group Plc	1.517	0,01
234	SSE Plc	4.789	0,04
2.521	Tesco Plc	6.760	0,06
238	Unilever Plc	11.956	0,11
1.875	Vodafone Group Plc	1.889	0,02
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>73.519</b>	<b>0,65</b>
<b>Südafrikanischer Rand</b>			
231	Absa Group Ltd	2.619	0,02
282	Nedbank Group Ltd	3.523	0,03
223	Standard Bank Group Ltd	2.197	0,02
<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>		<b>8.339</b>	<b>0,07</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>			
66	Cheil Worldwide Inc	1.205	0,01
26	DB Insurance Co Ltd	1.348	0,01
68	GS Holdings Corp	2.360	0,02
50	Hana Financial Group Inc	1.665	0,02
9	LG Chem Ltd	4.298	0,04
224	Samsung Electronics Co Ltd	9.832	0,09
68	Samsung Electronics Co Ltd - Preferred Shares	2.725	0,02
8	Samsung SDI Co Ltd	3.756	0,03
21	SK Hynix Inc	1.253	0,01
56	SK Telecom Co Ltd	2.101	0,02
<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>		<b>30.543</b>	<b>0,27</b>
<b>Schweizer Franken</b>			
101	ABB Ltd	3.076	0,03
158	Holcim AG	8.174	0,07
22	Kuehne + Nagel International AG	5.112	0,05
143	Novartis AG	12.933	0,11
9	Roche Holding AG	2.826	0,03
17	Swiss Re AG	1.589	0,01
8	Swisscom AG	4.380	0,04
17	Zurich Insurance Group AG	8.122	0,07
<b>Schweizer Franken insgesamt</b>		<b>46.212</b>	<b>0,41</b>

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 25,06 % (31. Dezember 2021: 27,38 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
61	3M Co	7.315	0,06
131	AbbVie Inc	21.171	0,19
213	Aflac Inc	15.323	0,13
1.579	Agree Realty Corp	25.438	0,22
35	Allstate Corp	4.746	0,04
300	American Electric Power Co Inc	28.485	0,25
488	American Homes 4 Rent	10.814	0,10
9	Amgen Inc	2.364	0,02
6.000	Antero Midstream Corp	64.740	0,57
953	AT&T Inc	17.545	0,15
1.700	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	44.030	0,39
17	Automatic Data Processing Inc	4.061	0,04
26	Bank of America Corp	861	0,01
281	Bristol-Myers Squibb Co	20.218	0,18
40	Broadcom Inc	22.365	0,20
1.300	Brookfield Renewable Corp Class A	35.802	0,32
30	Caterpillar Inc	7.187	0,06
184	Cedar Realty Trust Inc	2.164	0,02
2.800	CenterPoint Energy Inc	83.972	0,74
33	CH Robinson Worldwide Inc	3.021	0,03
2.200	Chatham Lodging Trust	44.088	0,39
650	Cheniere Energy Inc	97.474	0,86
126	Chevron Corp	22.616	0,20
5	Chubb Ltd	1.103	0,01
6	Cigna Corp	1.988	0,02
368	Cisco Systems Inc	17.531	0,15
320	Citigroup Inc	14.474	0,13
2.500	Clearway Energy Inc Class C	79.675	0,70
352	Coca-Cola Co	22.391	0,20
225	Comcast Corp Class A	7.868	0,07
85	Comerica Inc	5.682	0,05
6	ConocoPhillips	708	0,01
38	Consolidated Edison Inc	3.622	0,03
350	CTO Realty Growth Inc	7.157	0,06
215	CVS Health Corp	20.036	0,18
79	Devon Energy Corp	4.859	0,04
457	DiamondRock Hospitality Co	11.370	0,10
300	Digital Realty Trust Inc	6.843	0,06
750	DigitalBridge Group Inc	14.070	0,12
127	Dominion Energy Inc	7.788	0,07

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 25,06 % (31. Dezember 2021: 27,38 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
131	Dow Inc	6.601	0,06
59	Duke Energy Corp	6.076	0,05
62	Edison International	3.944	0,03
47	Emerson Electric Co	4.515	0,04
1.300	Enbridge Inc	50.830	0,45
20	Entergy Corp	2.250	0,02
21	Everest Re Group Ltd	6.957	0,06
139	Exelon Corp	6.009	0,05
196	Exxon Mobil Corp	21.619	0,19
900	Federal Realty Investment Trust	18.162	0,16
179	FirstEnergy Corp	7.507	0,07
245	General Mills Inc	20.543	0,18
108	Genuine Parts Co	18.739	0,16
162	Gilead Sciences Inc	13.908	0,12
500	Global Net Lease Inc	10.515	0,09
4	Goldman Sachs Group Inc	1.374	0,01
202	Hartford Financial Services Group Inc	15.318	0,13
453	Hersha Hospitality Trust HPP	8.473	0,07
1.654	Hersha Hospitality Trust Series C	33.022	0,29
500	Hersha Hospitality Trust SHP	9.250	0,08
215	HP Inc	5.777	0,05
463	Hudson Pacific Properties Inc	5.801	0,05
66	Illinois Tool Works Inc	14.540	0,13
107	International Business Machines Corp	15.075	0,13
49	Interpublic Group of Cos Inc	1.632	0,01
119	Johnson & Johnson	21.021	0,19
73	JPMorgan Chase & Co	9.789	0,09
61	Kellogg Co	4.346	0,04
1.800	Kinetik Holdings Inc Class A	59.544	0,52
49	Lockheed Martin Corp	23.838	0,21
127	LyondellBasell Industries NV Class A	10.545	0,09
144	Marathon Petroleum Corp	16.760	0,15
13	McDonald's Corp	3.426	0,03
173	Merck & Co Inc	19.194	0,17
120	MetLife Inc	8.684	0,08
86	Morgan Stanley	7.312	0,06
86	NetApp Inc	5.165	0,05
600	NextEra Energy Inc	50.160	0,44
1.200	NextEra Energy Partners LP	84.108	0,74
9	Norfolk Southern Corp	2.218	0,02

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Aktien 25,06 % (31. Dezember 2021: 27,38 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
1.250	ONEOK Inc	82.125	0,72
66	PACCAR Inc	6.532	0,06
60	Packaging Corp of America	7.675	0,07
26	Paychex Inc	3.005	0,03
2.100	Pembina Pipeline Corp	71.295	0,63
88	PepsiCo Inc	15.898	0,14
346	Pfizer Inc	17.729	0,16
66	Pioneer Natural Resources Co	15.074	0,13
146	Procter & Gamble Co	22.128	0,19
17	Progressive Corp	2.205	0,02
9	Prudential Financial Inc	895	0,01
142	Public Service Enterprise Group Inc	8.700	0,08
1.000	Public Storage PRH	23.290	0,20
500	Public Storage PRN	8.135	0,07
950	Public Storage PRQ	15.599	0,14
13	QUALCOMM Inc	1.429	0,01
699	Rexford Industrial Realty Inc	15.525	0,14
437	Sempra Energy	67.534	0,59
49	Snap-on Inc	11.196	0,10
156	Southern Co	11.140	0,10
145	Starbucks Corp	14.384	0,13
175	Summit Hotel Properties Inc	3.199	0,03
1.000	Summit Hotel Properties Inc Series E	17.130	0,15
300	Sunstone Hotel Investors Inc	5.820	0,05
202	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	15.047	0,13
1.500	Targa Resources Corp	110.250	0,97
1.000	TC Energy Corp	39.860	0,35
98	Texas Instruments Inc	16.192	0,14
54	Travelers Cos Inc	10.124	0,09
122	Truist Financial Corp	5.250	0,05
745	UMH Properties Inc	16.576	0,15
72	Union Pacific Corp	14.909	0,13
105	United Parcel Service Inc Class B	18.253	0,16
90	US Bancorp	3.925	0,03
37	Valero Energy Corp	4.694	0,04
79	Verizon Communications Inc	3.113	0,03
2.700	Williams Cos Inc	88.830	0,78
39	Yum! Brands Inc	4.995	0,04
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>2.247.172</b>	<b>19,77</b>
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>2.848.448</b>	<b>25,06</b>



## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Immobilienaktiengesellschaften 3,21 % (31. Dezember 2021: 6,55 %)</b>			
<b>Südafrikanischer Rand</b>			
2.535	Growthpoint Properties Ltd	2.166	0,02
<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>		<b>2.166</b>	<b>0,02</b>
<b>US-Dollar</b>			
137	AGNC Investment Corp	1.418	0,01
30	Alexandria Real Estate Equities Inc	4.370	0,04
137	American Homes 4 Rent Class A	4.129	0,04
120	American Tower Corp	25.423	0,22
687	Annaly Capital Management Inc	14.482	0,13
296	Apartment Income REIT Corp	10.156	0,09
970	Blackstone Mortgage Trust Inc Class A	20.535	0,18
48	Boston Properties Inc	3.244	0,03
152	Crown Castle Inc	20.617	0,18
115	Digital Realty Trust Inc	11.531	0,10
145	Equity LifeStyle Properties Inc	9.367	0,08
247	Equity Residential	14.573	0,13
40	Essex Property Trust Inc	8.477	0,07
248	Invitation Homes Inc	7.351	0,06
222	Iron Mountain Inc	11.067	0,10
423	Kimco Realty Corp	8.959	0,08
652	Medical Properties Trust Inc	7.263	0,06
472	Omega Healthcare Investors Inc	13.192	0,12
203	Prologis Inc	22.884	0,20
59	Public Storage	16.531	0,14
180	Realty Income Corp	11.417	0,10
190	Simon Property Group Inc	22.321	0,20
104	Spirit Realty Capital Inc	4.153	0,04
233	STAG Industrial Inc	7.528	0,07
362	Starwood Property Trust Inc	6.636	0,06
55	Sun Communities Inc	7.865	0,07
836	Tanger Factory Outlet Centers Inc	14.998	0,13
244	Ventas Inc	10.992	0,10
355	VICI Properties Inc	11.502	0,10
243	Vornado Realty Trust	5.057	0,04
274	Welltower Inc	17.961	0,16
85	WP Carey Inc	6.643	0,06
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>362.642</b>	<b>3,19</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>		<b>364.808</b>	<b>3,21</b>

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Fälligkeitsdatum	Zeitwert% des Netto-US\$	vermögens
<b>Participatory Notes 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>				
<b>Australischer Dollar</b>				
3	Magellan Financial Group Ltd	16.04.2027	0	0,00
<b>Participatory Notes insgesamt **</b>			<b>0</b>	<b>0,00</b>

Kapitalbetrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Zeitwert% des Netto-US\$	vermögens
<b>Agency Bonds 0,07 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
15.000	Fannie Mae Principal Strip	0,00 %	15.07.2037	7.644	0,07
<b>Agency Bonds insgesamt **</b>				<b>7.644</b>	<b>0,07</b>

<b>Unternehmensanleihen 42,94 % (31. Dezember 2021: 38,75 %)</b>					
<b>Euro</b>					
100.000	Adient Global Holdings Ltd <sup>†</sup>	3,50 %	15.08.2024	102.652	0,90
100.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy <sup>†</sup>	3,63 %	04.02.2028	90.934	0,80
100.000	Altice Financing SA <sup>**</sup>	4,25 %	15.08.2029	86.949	0,77
100.000	Altice France Holding SA <sup>†</sup>	8,00 %	15.05.2027	79.110	0,70
100.000	Ashland Services BV <sup>**</sup>	2,00 %	30.01.2028	91.618	0,81
100.000	Assemblin Financing AB <sup>**</sup>	7,05 %	15.05.2025	104.758	0,92
100.000	Avantor Funding Inc <sup>†</sup>	3,88 %	15.07.2028	99.252	0,87
100.000	Bayer AG <sup>†</sup>	5,38 %	25.03.2082	93.873	0,83
100.000	Cellnex Finance Co SA <sup>†</sup>	1,50 %	08.06.2028	89.208	0,78
100.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH <sup>**</sup>	4,38 %	15.01.2028	94.343	0,83
100.000	Dufry One BV <sup>†</sup>	3,38 %	15.04.2028	89.008	0,78
100.000	eG Global Finance Plc <sup>†</sup>	3,63 %	07.02.2024	101.537	0,89
100.000	Electricite de France SA <sup>†</sup>	5,00 %	29.12.2049	97.747	0,86
100.000	Emeria SASU <sup>**</sup>	3,38 %	31.03.2028	89.438	0,79
100.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG <sup>†</sup>	1,38 %	31.08.2081	79.303	0,70
100.000	Faurecia SE <sup>†</sup>	2,38 %	15.06.2027	89.459	0,79
100.000	Gruenthal GmbH <sup>**</sup>	4,13 %	15.05.2028	96.535	0,85
100.000	Iliad Holding SASU <sup>**</sup>	5,63 %	15.10.2028	97.363	0,86
100.000	INEOS Finance Plc <sup>†</sup>	2,88 %	01.05.2026	92.346	0,81
100.000	Intrum AB <sup>†</sup>	3,50 %	15.07.2026	90.144	0,79
100.000	Lorca Telecom Bondco SA <sup>†</sup>	4,00 %	18.09.2027	96.054	0,85
120.000	Petroleos Mexicanos <sup>†</sup>	4,75 %	26.02.2029	100.540	0,88
100.000	SPCM SA <sup>†</sup>	2,63 %	01.02.2029	90.045	0,79
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH <sup>**</sup>	2,00 %	15.07.2025	98.454	0,87
100.000	Telecom Italia SpA <sup>†</sup>	2,38 %	12.10.2027	90.230	0,79
100.000	Telefonica Europe BV <sup>†</sup>	3,88 %	29.12.2049	97.034	0,85
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>†</sup>	4,38 %	09.05.2030	89.022	0,78
100.000	Veolia Environnement SA <sup>†</sup>	2,50 %	29.12.2049	85.377	0,75
100.000	Verisure Midholding AB <sup>†</sup>	5,25 %	15.02.2029	86.175	0,76

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 42,94 % (31. Dezember 2021: 38,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
100.000	Virgin Media Finance Plc**	3,75 %	15.07.2030	82.810	0,73
100.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88 %	29.12.2049	88.837	0,78
100.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	81.825	0,72
<b>Euro insgesamt</b>				<b>2.941.980</b>	<b>25,88</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
100.000	Electricite de France SA*	5,88 %	29.12.2049	99.634	0,88
100.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	114.083	1,00
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>213.717</b>	<b>1,88</b>
<b>US-Dollar</b>					
5.000	Abbott Laboratories*	4,90 %	30.11.2046	4.903	0,04
5.000	AbbVie Inc*	4,05 %	21.11.2039	4.301	0,04
5.000	AbbVie Inc*	4,30 %	14.05.2036	4.521	0,04
5.000	AbbVie Inc*	4,70 %	14.05.2045	4.465	0,04
5.000	Adventist Health System**	5,43 %	01.03.2032	4.939	0,04
10.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,85 %	29.10.2041	7.105	0,06
70.000	Ally Financial Inc**	4,70 %	29.12.2049	47.031	0,41
10.000	Amazon.com Inc**	2,88 %	12.05.2041	7.502	0,07
5.000	Amgen Inc**	3,15 %	21.02.2040	3.701	0,03
5.000	Amgen Inc**	4,40 %	01.05.2045	4.212	0,04
5.000	Analog Devices Inc**	2,95 %	01.10.2051	3.393	0,03
5.000	Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,70 %	01.02.2036	4.741	0,04
5.000	Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,90 %	01.02.2046	4.571	0,04
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,44 %	06.10.2048	4.296	0,04
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,95 %	15.01.2042	4.712	0,04
5.000	Aon Corp/Aon Global Holdings Plc*	3,90 %	28.02.2052	3.884	0,03
5.000	Apple Inc**	2,65 %	08.02.2051	3.321	0,03
5.000	Apple Inc**	2,70 %	05.08.2051	3.320	0,03
5.000	Apple Inc**	3,75 %	13.11.2047	4.142	0,04
5.000	ArcelorMittal SA*	6,80 %	29.11.2032	4.986	0,04
5.000	AT&T Inc*	3,50 %	01.06.2041	3.748	0,03
5.000	AT&T Inc*	3,55 %	15.09.2055	3.359	0,03
5.000	AT&T Inc**	3,65 %	15.09.2059	3.370	0,03
5.000	AT&T Inc*	3,80 %	01.12.2057	3.473	0,03
3.000	AT&T Inc*	4,50 %	09.03.2048	2.457	0,02
5.000	Athene Holding Ltd*	3,95 %	25.05.2051	3.394	0,03
5.000	Atmos Energy Corp*	4,13 %	15.03.2049	4.117	0,04
5.000	AvalonBay Communities Inc*	5,00 %	15.02.2033	4.936	0,04
5.000	Bank of America Corp**	2,68 %	19.06.2041	3.381	0,03

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 42,94 % (31. Dezember 2021: 38,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.000	Bank of America Corp**	4,08 %	20.03.2051	3.937	0,03
5.000	Bank of America Corp**	4,24 %	24.04.2038	4.266	0,04
35.000	Bank of America Corp**	4,30 %	29.12.2049	30.320	0,27
65.000	Bank of New York Mellon Corp**	3,75 %	29.12.2049	52.517	0,46
5.000	BAT Capital Corp*	4,54 %	15.08.2047	3.552	0,03
5.000	Baxter International Inc**	3,13 %	01.12.2051	3.249	0,03
5.000	Berkshire Hathaway Energy Co*	6,13 %	01.04.2036	5.267	0,05
5.000	Berkshire Hathaway Finance Corp*	5,75 %	15.01.2040	5.454	0,05
5.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	4.661	0,04
5.000	BP Capital Markets Plc*	4,88 %	29.12.2049	4.391	0,04
5.000	Bristol-Myers Squibb Co*	2,55 %	13.11.2050	3.155	0,03
5.000	Bristol-Myers Squibb Co**	4,25 %	26.10.2049	4.324	0,04
5.000	Broadcom Inc**	4,30 %	15.11.2032	4.421	0,04
5.000	Burlington Northern Santa Fe LLC*	4,38 %	01.09.2042	4.480	0,04
5.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	3,57 %	01.12.2031	4.130	0,04
5.000	CenterPoint Energy Inc*	3,70 %	01.09.2049	3.734	0,03
10.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	3,50 %	01.06.2041	6.549	0,06
5.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	3.649	0,03
5.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	5,25 %	01.04.2053	3.880	0,03
5.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	5,38 %	01.04.2038	4.180	0,04
5.000	Chevron Corp*	3,08 %	11.05.2050	3.613	0,03
5.000	Cigna Corp*	4,80 %	15.08.2038	4.661	0,04
5.000	Citigroup Inc**	3,06 %	25.01.2033	4.048	0,04
80.000	Citigroup Inc**	4,15 %	29.12.2049	65.514	0,58
100.000	CMS Energy Corp**	3,75 %	01.12.2050	75.556	0,66
5.000	Comcast Corp**	2,65 %	15.08.2062	2.817	0,02
5.000	Comcast Corp**	2,94 %	01.11.2056	3.115	0,03
5.000	Comcast Corp**	4,65 %	15.07.2042	4.538	0,04
5.000	ConocoPhillips Co**	3,80 %	15.03.2052	3.957	0,03
5.000	Constellation Brands Inc*	4,50 %	09.05.2047	4.236	0,04
200.000	Credit Suisse Group AG*	5,10 %	29.12.2049	116.233	1,02
5.000	CVS Health Corp*	4,13 %	01.04.2040	4.180	0,04
5.000	CVS Health Corp*	5,05 %	25.03.2048	4.513	0,04
5.000	Danaher Corp*	4,38 %	15.09.2045	4.461	0,04
5.000	Diamondback Energy Inc**	4,40 %	24.03.2051	3.832	0,03
75.000	Discover Financial Services**	5,50 %	29.12.2049	59.983	0,53
5.000	Discovery Communications LLC**	4,65 %	15.05.2050	3.457	0,03
5.000	Dominion Energy Inc*	4,85 %	15.08.2052	4.345	0,04
5.000	Dominion Energy Inc*	5,38 %	15.11.2032	4.972	0,04
5.000	Duke Energy Corp*	4,80 %	15.12.2045	4.427	0,04

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 42,94 % (31. Dezember 2021: 38,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.000	Duke Energy Corp <sup>*</sup>	5,00 %	15.08.2052	4.464	0,04
5.000	Duke Energy Progress LLC <sup>*</sup>	2,50 %	15.08.2050	3.022	0,03
5.000	Edison International <sup>**</sup>	5,00 %	29.12.2049	4.192	0,04
5.000	Emerson Electric Co <sup>*</sup>	2,80 %	21.12.2051	3.240	0,03
5.000	Enbridge Inc <sup>*</sup>	4,00 %	15.11.2049	3.843	0,03
5.000	Entergy Louisiana LLC <sup>*</sup>	4,75 %	15.09.2052	4.515	0,04
5.000	Enterprise Products Operating LLC <sup>*</sup>	3,70 %	31.01.2051	3.628	0,03
5.000	Enterprise Products Operating LLC <sup>*</sup>	4,85 %	15.03.2044	4.431	0,04
5.000	EPR Properties <sup>**</sup>	4,95 %	15.04.2028	4.274	0,04
5.000	Essential Utilities Inc <sup>*</sup>	4,28 %	01.05.2049	4.054	0,04
5.000	Essential Utilities Inc <sup>*</sup>	5,30 %	01.05.2052	4.704	0,04
5.000	Evergy Kansas Central Inc <sup>*</sup>	3,45 %	15.04.2050	3.642	0,03
5.000	Exxon Mobil Corp <sup>*</sup>	4,23 %	19.03.2040	4.521	0,04
5.000	General Electric Co <sup>*</sup>	4,50 %	11.03.2044	4.322	0,04
5.000	Gilead Sciences Inc <sup>**</sup>	2,60 %	01.10.2040	3.508	0,03
5.000	Gilead Sciences Inc <sup>**</sup>	4,50 %	01.02.2045	4.423	0,04
35.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	3,65 %	29.12.2049	28.350	0,25
10.000	Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>	4,02 %	31.10.2038	8.258	0,07
5.000	Hartford Financial Services Group Inc <sup>*</sup>	2,90 %	15.09.2051	3.165	0,03
5.000	HCA Inc <sup>*</sup>	5,25 %	15.06.2049	4.282	0,04
5.000	Hess Corp <sup>*</sup>	5,80 %	01.04.2047	4.799	0,04
5.000	Home Depot Inc <sup>*</sup>	3,30 %	15.04.2040	4.002	0,04
5.000	Home Depot Inc <sup>*</sup>	4,40 %	15.03.2045	4.493	0,04
5.000	HSBC Holdings Plc <sup>*</sup>	5,40 %	11.08.2033	4.644	0,04
200.000	ING Groep NV <sup>*</sup>	3,88 %	29.12.2049	146.724	1,29
5.000	Intel Corp <sup>**</sup>	4,90 %	05.08.2052	4.450	0,04
5.000	JPMorgan Chase & Co <sup>**</sup>	2,53 %	19.11.2041	3.287	0,03
65.000	JPMorgan Chase & Co <sup>**</sup>	3,65 %	29.12.2049	55.819	0,49
5.000	JPMorgan Chase & Co <sup>*</sup>	5,40 %	06.01.2042	4.926	0,04
5.000	Kaiser Foundation Hospitals <sup>**</sup>	4,15 %	01.05.2047	4.261	0,04
5.000	Kentucky Utilities Co <sup>*</sup>	3,30 %	01.06.2050	3.537	0,03
5.000	Kinder Morgan Inc <sup>*</sup>	5,55 %	01.06.2045	4.582	0,04
5.000	KLA Corp <sup>**</sup>	4,95 %	15.07.2052	4.673	0,04
5.000	Kraft Heinz Foods Co <sup>**</sup>	4,38 %	01.06.2046	4.086	0,04
45.000	Liberty Mutual Group Inc <sup>**</sup>	4,13 %	15.12.2051	36.718	0,32
5.000	Lockheed Martin Corp <sup>*</sup>	4,30 %	15.06.2062	4.231	0,04
5.000	Lockheed Martin Corp <sup>*</sup>	5,90 %	15.11.2063	5.404	0,05
5.000	Lowe's Cos Inc <sup>*</sup>	5,63 %	15.04.2053	4.815	0,04
5.000	LYB International Finance BV <sup>*</sup>	4,88 %	15.03.2044	4.189	0,04
60.000	M&T Bank Corp <sup>**</sup>	3,50 %	29.12.2049	46.651	0,41

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 42,94 % (31. Dezember 2021: 38,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.000	Magellan Midstream Partners LP*	3,95 %	01.03.2050	3.681	0,03
5.000	Marathon Oil Corp*	5,20 %	01.06.2045	4.301	0,04
5.000	McDonald's Corp*	3,63 %	01.09.2049	3.785	0,03
5.000	MDC Holdings Inc*	3,97 %	06.08.2061	2.810	0,02
5.000	Merck & Co Inc*	2,90 %	10.12.2061	3.203	0,03
5.000	MetLife Inc*	4,88 %	13.11.2043	4.697	0,04
5.000	Microsoft Corp**	2,53 %	01.06.2050	3.314	0,03
5.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	3.899	0,03
5.000	Morgan Stanley**	2,48 %	16.09.2036	3.637	0,03
10.000	Morgan Stanley**	3,97 %	22.07.2038	8.457	0,07
5.000	MPLX LP*	5,50 %	15.02.2049	4.418	0,04
5.000	Nasdaq Inc**	2,50 %	21.12.2040	3.259	0,03
210.000	NatWest Group Plc*	4,60 %	29.12.2049	150.870	1,33
5.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc*	3,00 %	15.01.2052	3.287	0,03
5.000	NiSource Inc*	3,95 %	30.03.2048	3.902	0,03
5.000	Norfolk Southern Corp**	3,94 %	01.11.2047	4.026	0,04
5.000	Norfolk Southern Corp*	4,55 %	01.06.2053	4.374	0,04
10.000	Oglethorpe Power Corp**	4,50 %	01.04.2047	7.987	0,07
5.000	Oracle Corp*	3,95 %	25.03.2051	3.584	0,03
5.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.07.2046	3.664	0,03
5.000	Oracle Corp*	5,38 %	15.07.2040	4.609	0,04
5.000	PacifiCorp*	3,30 %	15.03.2051	3.615	0,03
5.000	Paramount Global**	4,60 %	15.01.2045	3.509	0,03
5.000	Philip Morris International Inc*	4,50 %	20.03.2042	4.239	0,04
5.000	Philip Morris International Inc**	5,75 %	17.11.2032	5.113	0,04
66.000	PNC Financial Services Group Inc**	3,40 %	29.12.2049	52.470	0,46
5.000	Prudential Financial Inc*	4,60 %	15.05.2044	4.470	0,04
5.000	Public Service Electric & Gas Co*	3,85 %	01.05.2049	3.985	0,04
5.000	QUALCOMM Inc**	6,00 %	20.05.2053	5.342	0,05
5.000	Raytheon Technologies Corp*	4,50 %	01.06.2042	4.520	0,04
5.000	Rogers Communications Inc*	4,35 %	01.05.2049	3.845	0,03
5.000	Shell International Finance BV*	4,38 %	11.05.2045	4.394	0,04
5.000	Southern Co*	4,40 %	01.07.2046	4.194	0,04
5.000	Southern Co Gas Capital Corp.*	3,15 %	30.09.2051	3.259	0,03
5.000	Southwestern Public Service Co**	3,15 %	01.05.2050	3.474	0,03
5.000	Starbucks Corp**	4,45 %	15.08.2049	4.275	0,04
5.000	Suncor Energy Inc*	6,50 %	15.06.2038	5.148	0,05
55.000	SVB Financial Group**	4,25 %	29.12.2049	36.186	0,32
5.000	T-Mobile USA Inc**	3,00 %	15.02.2041	3.547	0,03
5.000	T-Mobile USA Inc*	4,38 %	15.04.2040	4.288	0,04

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 42,94 % (31. Dezember 2021: 38,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.000	Union Pacific Corp <sup>*</sup>	3,50 %	14.02.2053	3.780	0,03
5.000	Union Pacific Corp <sup>*</sup>	3,80 %	01.10.2051	4.004	0,04
5.000	Union Pacific Corp <sup>**</sup>	3,84 %	20.03.2060	3.890	0,03
5.000	UnitedHealth Group Inc <sup>*</sup>	2,75 %	15.05.2040	3.647	0,03
5.000	UnitedHealth Group Inc <sup>*</sup>	4,75 %	15.05.2052	4.644	0,04
110.000	US Bancorp <sup>**</sup>	3,70 %	29.12.2049	90.200	0,79
5.000	Utah Acquisition Sub Inc <sup>**</sup>	5,25 %	15.06.2046	3.799	0,03
5.000	Verizon Communications Inc <sup>*</sup>	2,88 %	20.11.2050	3.156	0,03
5.000	Verizon Communications Inc <sup>*</sup>	3,70 %	22.03.2061	3.512	0,03
5.000	Verizon Communications Inc <sup>*</sup>	4,86 %	21.08.2046	4.507	0,04
5.000	Vodafone Group Plc <sup>**</sup>	4,38 %	19.02.2043	4.023	0,04
5.000	Walmart Inc <sup>*</sup>	2,50 %	22.09.2041	3.669	0,03
5.000	Walmart Inc <sup>*</sup>	2,65 %	22.09.2051	3.406	0,03
5.000	Walt Disney Co <sup>*</sup>	4,70 %	23.03.2050	4.618	0,04
5.000	Waste Management Inc <sup>*</sup>	2,50 %	15.11.2050	3.138	0,03
5.000	Westlake Corp <sup>*</sup>	4,38 %	15.11.2047	3.784	0,03
5.000	Westpac Banking Corp <sup>**</sup>	3,13 %	18.11.2041	3.316	0,03
5.000	Williams Cos Inc <sup>*</sup>	5,30 %	15.08.2052	4.497	0,04
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>1.725.211</b>	<b>15,18</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>4.880.908</b>	<b>42,94</b>
<b>Staatsanleihen 2,74 % (31. Dezember 2021: 5,70 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
25.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	1,25 %	15.05.2050	13.463	0,12
25.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	1,75 %	15.08.2041	17.121	0,15
5.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	1,88 %	15.02.2032	4.243	0,04
10.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	1,88 %	15.11.2051	6.337	0,06
27.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,00 %	15.11.2041	19.292	0,17
25.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,00 %	15.08.2051	16.378	0,14
5.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,25 %	15.08.2046	3.543	0,03
15.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,25 %	15.02.2052	10.437	0,09
30.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,38 %	15.05.2051	21.534	0,19
25.000	United States Treasury Note/Bond <sup>**</sup>	2,50 %	15.02.2045	18.845	0,17
10.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,50 %	15.05.2046	7.470	0,07
20.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,75 %	15.08.2032	18.216	0,16
15.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,75 %	15.08.2047	11.716	0,10
5.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,75 %	15.11.2047	3.904	0,03
10.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,88 %	15.08.2045	8.061	0,07
10.000	United States Treasury Note/Bond <sup>*</sup>	2,88 %	15.05.2049	8.052	0,07

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 2,74 % (31. Dezember 2021: 5,70 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
25.000	United States Treasury Note/Bond*	2,88 %	15.05.2052	20.039	0,18
20.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00 %	15.11.2044	16.525	0,14
25.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00 %	15.05.2045	20.620	0,18
10.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00 %	15.05.2047	8.190	0,07
5.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00 %	15.08.2052	4.121	0,04
20.000	United States Treasury Note/Bond*	3,13 %	15.08.2044	16.919	0,15
5.000	United States Treasury Note/Bond*	3,13 %	15.05.2048	4.205	0,04
5.000	United States Treasury Note/Bond*	3,38 %	15.08.2042	4.470	0,04
5.000	United States Treasury Note/Bond*	3,38 %	15.11.2048	4.413	0,04
10.000	United States Treasury Note/Bond**	3,63 %	15.08.2043	9.202	0,08
10.000	United States Treasury Note/Bond*	3,63 %	15.02.2044	9.182	0,08
5.000	United States Treasury Note/Bond*	4,13 %	15.11.2032	5.103	0,04
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>311.601</b>	<b>2,74</b>
Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung			Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Investmentfonds 5,30 % (31. Dezember 2021: 6,54 %)</b>					
<b>Britisches Pfund</b>					
386	iShares MSCI Brazil UCITS ETF			8.560	0,08
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>8.560</b>	<b>0,08</b>
<b>US-Dollar</b>					
2.921	iShares MSCI India UCITS ETF			21.063	0,19
40.890	Neuberger Berman China Bond Fund			388.047	3,41
16.300	Neuberger Berman Commodities Fund			184.515	1,62
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>593.625</b>	<b>5,22</b>
<b>Investmentfonds insgesamt <sup>h</sup></b>				<b>602.185</b>	<b>5,30</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>9.015.594</b>	<b>79,32</b>

Devisenterminkontrakte 1,41 % (31. Dezember 2021: 0,65 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht- realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
249.060 AUD	158.871 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	4	10.131	0,09
1.013 AUD	676 US\$	06.01.2023	Brown Brothers Harriman	1	11	0,00
129.398 AUD	84.278 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	3.526	0,03
63.648 AUD	42.675 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	514	0,00
125.571 AUD	84.921 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	287	0,00
223.464 BRL	41.590 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	610	0,01
55.546 CAD	40.324 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	674	0,01
57.408 CAD	42.023 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	349	0,00



## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,41 % (31. Dezember 2021: 0,65 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nichtrealisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
122.844 CHF	123.863 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	3	9.125	0,08
71.345 CHF	76.329 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	907	0,01
39.172 CHF	42.328 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	78	0,00
20.125.534 CLP	20.303 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	3.286	0,03
589.932 CNH	84.000 US\$	10.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.311	0,01
268.505 CZK	11.784 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	70	0,00
1.478.263 CZK	64.204 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	1.057	0,01
201.109 €	206.701 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	5	8.150	0,07
41.538 €	42.286 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	2.090	0,02
76.500 €	10.744.042 ¥	10.01.2023	Goldman Sachs International	1	185	0,00
1.925.497 €	2.027.930 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	4	29.134	0,26
101.391 €	102.029 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	6.289	0,06
158.703 €	163.009 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	6.538	0,06
123.948 £	142.849 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	6.307	0,06
36.082 £	41.652 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.768	0,02
3.033 HUF	7 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	1	0,00
13.906.487 ¥	99.174 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	3	6.427	0,06
21.990.537 ¥	153.000 €	10.01.2023	Goldman Sachs International	1	3.441	0,03
29.078.507 ¥	207.253 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	4	13.557	0,12
92.029.000 KRW	70.000 US\$	10.01.2023	Goldman Sachs International	1	3.086	0,03
820.665 MXN	40.348 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	1.650	0,01
117.339 NOK	11.012 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	907	0,01
310.700 NOK	30.600 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	959	0,01
56.669 NZD	32.993 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	2.855	0,02
40.900 NZD	25.855 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	18	0,00
356.949 NZD	202.998 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	22.802	0,20
19 PLN	4 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	1	0,00
840.328 SEK	77.031 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	3.688	0,03
462.240 SEK	41.948 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	2.453	0,02
142.316 US\$	116.770 £	18.01.2023	BNP Paribas	3	1.798	0,02
42.425 US\$	56.589 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	1	657	0,01
42.611 US\$	35.319 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	109	0,00
44.827 US\$	70.344 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	328	0,00
41.066 US\$	55.133 CAD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	373	0,00
42.371 US\$	223.975 BRL	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	75	0,00
27.773 US\$	37.537 CAD	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	68	0,00
41.749 US\$	65.595 NZD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	255	0,00
43.620 US\$	63.991 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	198	0,00
22.594 US\$	35.570 NZD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	93	0,00
40.689 US\$	398.636 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	198	0,00
84.970 US\$	133.857 NZD	18.01.2023	UBS AG	1	295	0,00

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,41 % (31. Dezember 2021: 0,65 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
70.737 ZAR	3.904 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	248	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
114 £	133 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	4	0,00
9.244 £	10.404 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	720	0,00
10.608 £	12.000 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	12	764	0,01
118 US\$	97 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1	0,00
646 US\$	529 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	9	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>160.435</b>	<b>1,41</b>

### Futures-Kontrakte 0,45 % (31. Dezember 2021: 0,07 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1)	Euro-Bund Future March 2023	9.755	0,09
(1)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	30.502	0,27
(2)	S&P 500 E-mini Future March 2023	10.775	0,09
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>51.032</b>	<b>0,45</b>

### Verkaufte Optionskontrakte 0,03 % (31. Dezember 2021: 0,01 %)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufoptionen</b>				
1	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,300	7	0,00
3	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,300	23	0,00
3	18.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,300	98	0,00
1	25.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,300	68	0,00
3	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,400	15	0,00
1	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,400	5	0,00
<b>Verkaufsoptionen</b>				
1	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,500	22	0,00
3	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,500	345	0,00
4	18.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,500	1.840	0,02
2	25.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,500	1.550	0,01
2	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,550	45	0,00
1	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,550	162	0,00
1	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,600	27	0,00
<b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt <sup>±</sup> (Prämie: (8.544) US\$)</b>			<b>4.207</b>	<b>0,03</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>9.231.268</b>	<b>81,21</b>

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (5,14 %) (31. Dezember 2021: (0,40 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
171.913 BRL	32.829 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(365)	(0,00)
55.670 CAD	41.783 US\$	18.01.2023	BNP Paribas	1	(694)	(0,01)
167.674 CAD	124.767 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(1.009)	(0,01)
114.744 CAD	84.756 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(65)	(0,00)
56.899 CAD	42.851 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(855)	(0,01)
39.967 CHF	43.396 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(129)	(0,00)
39.869 €	42.818 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(225)	(0,00)
90.078 £	108.552 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(154)	(0,00)
118.311 SEK	11.469 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(105)	(0,00)
864.821 SEK	84.254 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(1.182)	(0,01)
31.107 US\$	612.801 MXN	18.01.2023	BNP Paribas	1	(254)	(0,00)
125.447 US\$	120.969 CHF	18.01.2023	BNP Paribas	3	(5.511)	(0,05)
65.159 US\$	110.076 NZD	18.01.2023	BNP Paribas	2	(4.473)	(0,04)
39.753 US\$	35.445 £	18.01.2023	BNP Paribas	1	(2.901)	(0,03)
41.469 US\$	56.446 CAD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(193)	(0,00)
123.791 US\$	17.869.362 ¥	18.01.2023	BNP Paribas	3	(11.902)	(0,11)
41.150 US\$	65.159 AUD	18.01.2023	BNP Paribas	1	(3.064)	(0,03)
167.547 US\$	166.710 €	18.01.2023	BNP Paribas	4	(10.555)	(0,09)
325.366 US\$	288.232 £	18.01.2023	Deutsche Bank AG	1	(21.485)	(0,19)
44.942 US\$	44.667 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(3.413)	(0,03)
284.000 US\$	2.014.156 CNH	10.01.2023	Goldman Sachs International	3	(7.269)	(0,06)
52.204 US\$	546.953 SEK	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(334)	(0,00)
17.465 US\$	16.605.595 CLP	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(1.999)	(0,02)
55.450 US\$	7.489.923 ¥	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(1.425)	(0,01)
94.300 US\$	2.372.059 CZK	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(10.419)	(0,09)
83.264 US\$	141.724 NZD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(6.388)	(0,06)
77.697 US\$	70.324 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(6.929)	(0,06)
21.205 US\$	29.805.466 KRW	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(2.486)	(0,02)
117.214 US\$	114.609 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(5.226)	(0,05)
24.987 US\$	34.449 CAD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(439)	(0,00)
137.838 US\$	213.907 AUD	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(7.310)	(0,07)
157 US\$	3.226 TRY	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(14)	(0,00)
137.763 US\$	129.512 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	3	(598)	(0,01)
15.205 US\$	2.214.089 ¥	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(1.608)	(0,01)
9.156 US\$	8.106 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(599)	(0,01)
41.136 US\$	440.705 NOK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(3.628)	(0,03)
13.167 US\$	11.058 £	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(140)	(0,00)
75.987 US\$	112.532 AUD	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(373)	(0,00)
5.648.010 US\$	5.707.368 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	5	(449.339)	(3,95)
57.248 US\$	596.745 SEK	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(73)	(0,00)
43.468 US\$	40.574 CHF	18.01.2023	UBS AG	1	(456)	(0,00)

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (5,14 %) (31. Dezember 2021: (0,40 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
162.991 US\$	154.177 €	18.01.2023	UBS AG	4	(1.722)	(0,02)
130.487 US\$	180.290 CAD	18.01.2023	UBS AG	1	(2.582)	(0,02)
13.080 US\$	69.322 BRL	18.01.2023	UBS AG	1	(11)	(0,00)
64.489 US\$	8.613.611 ¥	18.01.2023	UBS AG	1	(920)	(0,01)
38.452 US\$	412.541 NOK	18.01.2023	UBS AG	1	(3.451)	(0,03)
6 US\$	46 CNY	18.01.2023	UBS AG	1	0	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
434 £	534 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(11)	(0,00)
723 US\$	645 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	(52)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(584.335)</b>	<b>(5,14)</b>

### Futures-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2021: (0,04 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1	TOPIX Index Future March 2023	(2.994)	(0,03)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>(2.994)</b>	<b>(0,03)</b>

### Verkaufte Optionskontrakte (0,52 %) (31. Dezember 2021: (0,08 %))

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufoptionen</b>				
(1)	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,970	(33)	(0,00)
(1)	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,970	(720)	(0,01)
(2)	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,980	(1.180)	(0,01)
(2)	18.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,980	(3.740)	(0,03)
(1)	18.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,990	(1.650)	(0,01)
(1)	25.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,000	(2.190)	(0,02)
(2)	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,065	(10)	(0,00)
(1)	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,075	(80)	(0,00)
(1)	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,120	(12)	(0,00)
<b>Verkaufsoptionen</b>				
(2)	25.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,750	(9.310)	(0,08)
(2)	18.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,755	(7.660)	(0,07)
(2)	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,765	(4.530)	(0,04)
(2)	18.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,765	(8.260)	(0,07)
(1)	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,775	(735)	(0,01)
(1)	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,775	(2.540)	(0,02)
(1)	11.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,840	(4.960)	(0,04)

## Multi-Asset Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (0,52 %) (31. Dezember 2021: (0,08 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(2)	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,850	(6.620)	(0,06)
(1)	04.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,880	(5.130)	(0,05)
(1)	06.01.2023	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$930	(357)	(0,00)
<b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 82.061 US\$)</b>			<b>(59.717)</b>	<b>(0,52)</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(647.046)</b>	<b>(5,69)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>8.584.222</b>	<b>75,52</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>2.781.893</b>	<b>24,48</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>11.366.115</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>		US\$	% des Gesamtver- mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	6.632.125	54,38
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.781.284	14,61
μ	Investmentfonds	602.185	4,94
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(7.472)	(0,06)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(423.900)	(3,48)
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>8.584.222</b>	<b>70,39</b>

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 92,48 % (31. Dezember 2021: 92,33 %)</b>			
<b>Kanadischer Dollar</b>			
27.962	First Quantum Minerals Ltd	583.819	0,39
30.798	Magna International Inc	1.728.843	1,17
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>		<b>2.312.662</b>	<b>1,56</b>
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
32.300	StarPower Semiconductor Ltd Class A	1.537.306	1,04
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>1.537.306</b>	<b>1,04</b>
<b>Euro</b>			
26.594	BE Semiconductor Industries NV	1.615.819	1,09
17.763	Infineon Technologies AG	538.238	0,36
25.244	Schneider Electric SE	3.534.534	2,39
<b>Euro insgesamt</b>		<b>5.688.591</b>	<b>3,84</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
48.200	Baidu Inc Class A	689.811	0,46
69.572	JD.com Inc Class A	1.962.825	1,33
103.236	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	1.228.126	0,83
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>3.880.762</b>	<b>2,62</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
35.614	Murata Manufacturing Co Ltd	1.778.203	1,20
37.541	Taiyo Yuden Co Ltd	1.089.712	0,74
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>2.867.915</b>	<b>1,94</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
50.000	MediaTek Inc	1.016.740	0,69
<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>		<b>1.016.740</b>	<b>0,69</b>
<b>Schwedische Krone</b>			
101.682	Epiroc AB Class A	1.854.267	1,25
<b>Schwedische Krone insgesamt</b>		<b>1.854.267</b>	<b>1,25</b>
<b>US-Dollar</b>			
22.625	Advanced Micro Devices Inc	1.465.421	0,99
8.741	Air Products & Chemicals Inc	2.694.501	1,82
19.239	Alphabet Inc Class A	1.697.457	1,15
35.625	Altair Engineering Inc Class A	1.619.869	1,09
24.080	Amazon.com Inc	2.022.720	1,37

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 92,48 % (31. Dezember 2021: 92,33 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
26.242	Ambarella Inc	2.157.880	1,46
78.465	Amphenol Corp Class A	5.974.325	4,04
37.304	Analog Devices Inc	6.118.975	4,13
23.848	ANSYS Inc	5.761.438	3,89
32.928	Applied Materials Inc	3.206.529	2,17
33.224	Aptiv Plc	3.094.151	2,09
6.260	ASML Holding NV	3.420.464	2,31
13.547	Autodesk Inc	2.531.528	1,71
118.338	Ballard Power Systems Inc	566.839	0,38
23.444	Cadence Design Systems Inc	3.766.044	2,54
18.551	Caterpillar Inc	4.444.078	3,00
61.386	ChargePoint Holdings Inc	585.009	0,40
10.314	Coherent Corp	362.021	0,24
10.022	Deere & Co	4.297.033	2,90
86.603	General Motors Co	2.913.325	1,97
132.839	Gentex Corp	3.622.520	2,45
13.861	Globalfoundries Inc	746.969	0,51
23.224	Keysight Technologies Inc	3.972.930	2,68
4.340	Lam Research Corp	1.824.102	1,23
55.707	Lattice Semiconductor Corp	3.614.270	2,44
13.421	Linde Plc	4.377.662	2,96
7.045	Micron Technology Inc	352.109	0,24
13.215	Mobileye Global Inc Class A	463.318	0,31
7.552	Monolithic Power Systems Inc	2.670.463	1,80
151.144	MP Materials Corp	3.669.776	2,48
72.490	NIO Inc ADR	706.777	0,48
16.582	NVIDIA Corp	2.423.293	1,64
14.176	NXP Semiconductors NV	2.240.233	1,51
31.612	ON Semiconductor Corp	1.971.640	1,33
9.271	Qorvo Inc	840.323	0,57
99.714	Rambus Inc	3.571.755	2,41
3.388	S&P Global Inc	1.134.777	0,77
42.075	Sensata Technologies Holding Plc	1.698.989	1,15
14.810	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.103.197	0,75
36.340	TE Connectivity Ltd	4.171.832	2,82
13.806	Tesla Inc	1.700.623	1,15
11.888	Texas Instruments Inc	1.964.135	1,33
23.679	T-Mobile US Inc	3.315.060	2,24
83.001	Trimble Inc	4.196.531	2,84
67.554	Uber Technologies Inc	1.670.610	1,13

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 92,48 % (31. Dezember 2021: 92,33 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
864	Verisk Analytics Inc Class A	152.427	0,10
7.539	Zscaler Inc	843.614	0,57
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>117.719.542</b>	<b>79,54</b>
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>136.877.785</b>	<b>92,48</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften 1,03 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
13.506	Prologis Inc	1.522.531	1,03
<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>		<b>1.522.531</b>	<b>1,03</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>138.400.316</b>	<b>93,51</b>

Devisenterminkontrakte 0,20 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
149.828 €	151.060 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	9.006	0,01
3.460 €	3.617 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	80	0,00
3.856.195 €	3.834.444 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	26	285.242	0,19
98 US\$	92 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>294.328</b>	<b>0,20</b>

					Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>138.694.644</b>	<b>93,71</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,14 %) (31. Dezember 2021: (0,05 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
9.994 €	10.715 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(38)	(0,00)
4.962 €	5.305 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
148.457 US\$	148.772 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(10.480)	(0,00)
8.799 US\$	8.238 €	18.01.2023	UBS AG	1	(2)	(0,00)
3.497.080 US\$	3.463.557 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	18	(203.138)	(0,14)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(213.661)</b>	<b>(0,14)</b>



## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(213.661)</b>	<b>(0,14)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>138.480.983</b>	<b>93,57</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>9.523.694</b>	<b>6,43</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>148.004.677</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	138.400.316	93,00
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	80.667	0,05
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>138.480.983</b>	<b>93,05</b>

## Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert % des Netto- US\$ vermögens	
<b>Aktien 94,00 %</b>			
<b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>			
25.820	Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A	103.745	1,22
<b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>		<b>103.745</b>	<b>1,22</b>
<b>Euro</b>			
2.879	Airbus SE	341.297	4,02
8.158	Avio SpA	83.293	0,98
36.676	Eutelsat Communications SA	272.562	3,21
1.984	Safran SA	247.761	2,92
1.838	Thales SA	234.137	2,76
<b>Euro insgesamt</b>		<b>1.179.050</b>	<b>13,89</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
46.800	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	172.026	2,03
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>172.026</b>	<b>2,03</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
30.747	Universal Microwave Technology Inc	134.551	1,58
<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>		<b>134.551</b>	<b>1,58</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
20.582	BAE Systems Plc	211.515	2,49
7.662	Smiths Group Plc	146.314	1,72
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>357.829</b>	<b>4,21</b>
<b>Singapur-Dollar</b>			
108.200	Singapore Technologies Engineering Ltd	270.258	3,18
<b>Singapur-Dollar insgesamt</b>		<b>270.258</b>	<b>3,18</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>			
5.353	Intellian Technologies Inc	288.684	3,40
<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>		<b>288.684</b>	<b>3,40</b>
<b>US-Dollar</b>			
2.763	Advanced Micro Devices Inc	178.960	2,11
1.919	Amazon.com Inc	161.196	1,90
977	Arista Networks Inc	118.559	1,40
232	ASML Holding NV	126.765	1,49
2.898	Ball Corp	148.204	1,75
776	CACI International Inc Class A	233.258	2,75

## Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 94,00 % (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
1.778	Crowdstrike Holdings Inc Class A	187.206	2,20
631	Deere & Co	270.548	3,19
1.245	Jacobs Solutions Inc	149.487	1,76
964	Keysight Technologies Inc	164.912	1,94
14.220	Kratos Defense & Security Solutions Inc	146.750	1,73
2.421	Leidos Holdings Inc	254.665	3,00
709	Microsoft Corp	170.032	2,00
2.355	Moog Inc Class A	206.675	2,43
1.328	Motorola Solutions Inc	342.239	4,03
1.009	NVIDIA Corp	147.455	1,74
1.312	Palo Alto Networks Inc	183.076	2,16
64.477	Planet Labs PBC	280.475	3,30
1.704	QUALCOMM Inc	187.338	2,21
2.823	Raytheon Technologies Corp	284.897	3,35
72.220	Rocket Lab USA Inc	272.269	3,21
607	Snowflake Inc Class A	87.129	1,03
1.008	Teledyne Technologies Inc	403.109	4,75
382	TransDigm Group Inc	240.526	2,83
3.697	Trimble Inc	186.920	2,20
6.951	Uber Technologies Inc	171.898	2,02
1.528	Zscaler Inc	170.983	2,01
	<b>US-Dollar insgesamt</b>	<b>5.475.531</b>	<b>64,49</b>
	<b>Aktien insgesamt *</b>	<b>7.981.674</b>	<b>94,00</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>7.981.674</b>	<b>94,00</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		<b>7.981.674</b>	<b>94,00</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>		<b>7.981.674</b>	<b>94,00</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>		<b>509.188</b>	<b>6,00</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>8.490.862</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind		7.981.674	93,13
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>7.981.674</b>	<b>93,13</b>

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Schatzwechsel 1,00 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
52.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	25.05.2023	51.075.667	1,00
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>51.075.667</b>	<b>1,00</b>
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %)</b>					
<b>Euro</b>					
15.300.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13 %	19.07.2024	2.924.919	0,06
2.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	2,88 %	25.10.2025	2.063.801	0,04
15.000.000	Petroleos Mexicanos*	3,75 %	21.02.2024	15.715.934	0,31
19.243.000	Petroleos Mexicanos*	5,13 %	15.03.2023	20.565.211	0,40
<b>Euro insgesamt</b>				<b>41.269.865</b>	<b>0,81</b>
<b>US-Dollar</b>					
54.200.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40 %	09.03.2023	53.065.997	1,04
4.317.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,95 %	31.07.2024	4.312.035	0,08
21.380.000	ABQ Finance Ltd*	1,88 %	08.09.2025	19.488.084	0,38
12.477.000	ABQ Finance Ltd*	2,00 %	06.07.2026	11.105.329	0,22
14.283.000	ABQ Finance Ltd*	3,13 %	24.09.2024	13.724.335	0,27
12.926.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	3,50 %	31.03.2027	12.231.228	0,24
5.370.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	4,50 %	14.09.2027	5.302.231	0,10
3.324.000	Access Bank Plc*	6,13 %	21.09.2026	2.589.396	0,05
6.409.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	5.864.235	0,11
7.200.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy*	6,25 %	10.12.2024	7.023.295	0,14
5.300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*	3,38 %	24.07.2024	5.025.539	0,10
5.000.000	ADCB Finance Cayman Ltd*	4,50 %	06.03.2023	4.992.793	0,10
7.758.000	Africa Finance Corp*	3,88 %	13.04.2024	7.572.786	0,15
8.509.000	African Export-Import Bank*	2,63 %	17.05.2026	7.654.024	0,15
7.500.000	African Export-Import Bank*	4,13 %	20.06.2024	7.336.592	0,14
300.000	African Export-Import Bank*	5,25 %	11.10.2023	298.909	0,01
5.589.000	AIA Group Ltd*	5,63 %	25.10.2027	5.705.081	0,11
8.000.000	AKCB Finance Ltd*	4,75 %	09.10.2023	7.944.128	0,15
5.600.000	Alfa SAB de CV**	5,25 %	25.03.2024	5.567.632	0,11
881.000	Alpek SAB de CV**	5,38 %	08.08.2023	881.626	0,02
11.941.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	11.860.040	0,23
26.613.000	Arab Petroleum Investments Corp*	4,13 %	18.09.2023	26.395.564	0,51
4.000.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63 %	07.10.2026	3.641.508	0,07
6.540.000	AUB Sukuk Ltd*	2,62 %	09.09.2026	5.898.845	0,11
15.700.000	Azure Orbit IV International Finance Ltd*	3,75 %	25.01.2023	15.680.232	0,31
2.552.000	Baidu Inc**	1,72 %	09.04.2026	2.273.194	0,04
18.828.000	Banco Bradesco SA*	3,20 %	27.01.2025	18.017.643	0,35

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
10.992.000	Banco Bradesco SA**	4,38 %	18.03.2027	10.556.937	0,21
18.882.000	Banco BTG Pactual SA*	2,75 %	11.01.2026	17.182.054	0,34
22.581.000	Banco BTG Pactual SA*	4,50 %	10.01.2025	21.795.407	0,43
13.000.000	Banco de Bogota SA*	6,25 %	12.05.2026	12.769.835	0,25
13.400.000	Banco de Credito del Peru SA**	2,70 %	11.01.2025	12.706.550	0,25
8.861.000	Banco del Estado de Chile*	2,70 %	09.01.2025	8.379.030	0,16
10.245.000	Banco do Brasil SA*	3,25 %	30.09.2026	9.443.636	0,18
13.515.000	Banco do Brasil SA*	4,88 %	19.04.2023	13.487.902	0,26
15.000.000	Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa*	4,13 %	06.06.2024	14.680.425	0,29
2.120.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank**	3,38 %	18.01.2023	2.118.368	0,04
9.000.000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC*	2,72 %	11.08.2031	7.541.376	0,15
6.297.000	Banco Santander Chile**	2,70 %	10.01.2025	5.984.209	0,12
29.442.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand**	5,38 %	17.04.2025	29.197.631	0,57
8.824.000	Banco Votorantim SA**	4,50 %	24.09.2024	8.572.957	0,17
19.200.000	Bancolombia SA*	3,00 %	29.01.2025	18.219.682	0,36
10.200.000	Bancolombia SA*	7,14 %	18.10.2027	10.057.062	0,20
7.431.000	Bangkok Bank PCL*	4,30 %	15.06.2027	7.162.141	0,14
5.241.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	4,75 %	13.05.2025	5.139.534	0,10
15.789.000	Bank Muscat SAOG*	4,75 %	17.03.2026	15.089.732	0,30
14.036.000	Bank Muscat SAOG*	4,88 %	14.03.2023	13.996.646	0,27
3.332.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	3,75 %	30.03.2026	3.096.722	0,06
10.833.000	BBK BSC*	5,50 %	09.07.2024	10.620.619	0,21
5.338.000	Beijing Gas Singapore Capital Corp*	1,88 %	18.01.2025	4.946.149	0,10
1.079.000	Bharti Airtel International Netherlands BV*	5,35 %	20.05.2024	1.073.670	0,02
5.677.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	5.129.851	0,10
22.421.147	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd**	0,00 %	05.06.2034	15.504.223	0,30
17.184.000	Black Sea Trade & Development Bank*	3,50 %	25.06.2024	15.569.442	0,30
6.988.000	Blossom Joy Ltd*	3,10 %	29.12.2049	6.555.457	0,13
8.457.000	BOC Aviation Ltd*	1,75 %	21.01.2026	7.601.763	0,15
6.600.000	BOC Aviation Ltd*	2,75 %	02.12.2023	6.443.741	0,13
3.487.000	BOC Aviation Ltd*	3,25 %	29.04.2025	3.309.772	0,06
200.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	18.09.2027	183.927	0,00
5.399.000	BOC Aviation Ltd*	4,00 %	25.01.2024	5.308.466	0,10
5.432.000	BOCOM International Blossom Ltd*	1,75 %	28.06.2026	4.873.020	0,09
5.399.000	Boubyan Sukuk Ltd**	2,59 %	18.02.2025	5.116.298	0,10
9.625.000	Boubyan Sukuk Ltd*	3,39 %	29.03.2027	9.050.888	0,18
7.151.000	Braskem Finance Ltd**	6,45 %	03.02.2024	7.179.568	0,14
18.266.213	Brazil Loan Trust 1*	5,48 %	24.07.2023	18.344.392	0,36
65.467.200	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais†	5,33 %	15.02.2028	63.990.587	1,25
19.430.000	BSF Finance*	5,50 %	23.11.2027	19.681.813	0,38

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
27.742.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	15.09.2025	25.417.331	0,50
24.369.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	12.05.2026	21.979.185	0,43
4.800.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	1,60 %	15.09.2026	4.237.680	0,08
8.549.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	1,99 %	21.07.2025	7.834.379	0,15
18.000.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	3,50 %	16.05.2024	17.544.924	0,34
7.821.000	CDBL Funding 1*	1,50 %	04.11.2023	7.581.224	0,15
1.293.000	CDBL Funding 1*	3,00 %	24.04.2023	1.283.619	0,02
12.000.000	CDBL Funding 2*	2,00 %	04.03.2026	10.916.280	0,21
8.200.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	7.773.354	0,15
3.439.000	Centrais Eletricas Brasileiras SA**	3,63 %	04.02.2025	3.273.275	0,06
7.800.000	Central American Bank for Economic Integration*	1,14 %	09.02.2026	6.938.022	0,14
4.926.000	Chalco Hong Kong Investment Co Ltd*	1,55 %	28.07.2024	4.641.438	0,09
5.399.000	China Cinda Finance 2015 I Ltd*	4,25 %	23.04.2025	5.208.671	0,10
10.036.000	China Construction Bank Corp*	1,25 %	04.08.2025	9.201.434	0,18
2.709.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	2.517.509	0,05
24.471.000	China Huadian Overseas Development 2018 Ltd*	3,38 %	29.12.2049	23.046.788	0,45
27.908.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd*	4,00 %	29.12.2049	27.284.843	0,53
4.090.000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd*	2,45 %	09.02.2026	3.306.047	0,06
18.174.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,13 %	03.06.2026	16.453.283	0,32
14.756.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,95 %	24.02.2027	13.570.223	0,26
8.442.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	4,10 %	29.12.2049	8.236.672	0,16
4.683.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	1,75 %	10.08.2023	4.585.064	0,09
6.237.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	2,00 %	26.01.2026	5.690.233	0,11
4.187.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95 %	20.10.2025	1.106.905	0,02
4.600.000	CITIC Ltd*	2,88 %	17.02.2027	4.252.629	0,08
4.303.000	CITIC Securities Finance MTN Co Ltd*	2,00 %	03.06.2025	3.988.694	0,08
9.192.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,25 %	16.09.2024	8.550.444	0,17
12.236.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	11.114.978	0,22
2.500.000	CMB International Leasing Management Ltd*	2,00 %	04.02.2026	2.247.975	0,04
14.815.000	CMHI Finance BVI Co Ltd*	4,00 %	01.06.2027	14.294.979	0,28
9.392.000	CNCBINV 1 (BVI) Ltd*	1,75 %	17.11.2024	8.733.424	0,17
27.000.000	Comision Federal de Electricidad*	4,75 %	23.02.2027	25.275.240	0,49
44.043.000	Comision Federal de Electricidad*	4,88 %	15.01.2024	43.711.136	0,85
6.871.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	5.901.138	0,11
23.570.000	Corp Andina de Fomento*	1,25 %	26.10.2024	21.904.695	0,43
27.333.000	Corp Andina de Fomento*	2,25 %	08.02.2027	24.506.143	0,48
18.000.000	Corp Andina de Fomento*	2,38 %	12.05.2023	17.797.672	0,35
628.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	6,15 %	17.09.2025	412.453	0,01
3.528.000	Credicorp Ltd**	2,75 %	17.06.2025	3.304.336	0,06
3.800.000	CSCIF Asia Ltd*	1,75 %	04.08.2025	3.462.900	0,07

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
16.200.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	15.494.035	0,30
5.948.000	CSN Resources SA**	7,63 %	17.04.2026	5.945.114	0,12
10.825.000	Development Bank of Kazakhstan JSC*	5,75 %	12.05.2025	10.836.908	0,21
13.401.000	Dianjian Haiyu Ltd*	4,30 %	29.12.2049	13.169.287	0,26
12.400.000	Dianjian International Finance Ltd*	4,60 %	29.12.2049	12.381.400	0,24
17.584.000	DIB Sukuk Ltd*	1,96 %	22.06.2026	15.819.008	0,31
14.741.000	DIB Sukuk Ltd*	2,74 %	16.02.2027	13.447.522	0,26
7.758.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95 %	20.02.2025	7.411.062	0,14
26.946.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95 %	16.01.2026	25.255.462	0,49
24.677.000	DIB Sukuk Ltd*	3,63 %	06.02.2023	24.634.850	0,48
15.584.000	DIB Sukuk Ltd*	5,49 %	30.11.2027	15.888.932	0,31
21.500.000	DP World Crescent Ltd*	3,91 %	31.05.2023	21.354.212	0,42
40.843.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88 %	23.05.2024	39.423.706	0,77
9.286.000	Eastern Creation II Investment Holdings Ltd*	1,00 %	10.09.2023	9.030.890	0,18
21.950.000	Ecopetrol SA*	4,13 %	16.01.2025	20.952.590	0,41
26.300.000	Ecopetrol SA*	5,38 %	26.06.2026	24.862.705	0,48
18.300.000	EI Sukuk Co Ltd*	1,83 %	23.09.2025	16.817.531	0,33
5.800.000	EI Sukuk Co Ltd*	2,08 %	02.11.2026	5.195.077	0,10
2.435.000	Embraer Netherlands Finance BV**	5,05 %	15.06.2025	2.367.380	0,05
32.420.000	Emirates Development Bank PJSC*	1,64 %	15.06.2026	28.980.497	0,57
28.200.000	Emirates Development Bank PJSC*	3,52 %	06.03.2024	27.633.395	0,54
9.165.000	Emirates NBD Bank PJSC*	1,64 %	13.01.2026	8.305.781	0,16
12.376.000	Emirates NBD Bank PJSC*	2,63 %	18.02.2025	11.757.138	0,23
20.828.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,63 %	21.10.2027	21.401.166	0,42
4.145.000	Endeavour Mining Plc*	5,00 %	14.10.2026	3.570.089	0,07
7.757.988	Energiean Israel Finance Ltd*	4,50 %	30.03.2024	7.484.519	0,15
11.568.000	Fab Sukuk Co Ltd*	1,41 %	14.01.2026	10.477.044	0,20
13.000.000	Fab Sukuk Co Ltd*	3,63 %	05.03.2023	12.958.755	0,25
22.088.000	Fab Sukuk Co Ltd*	3,88 %	22.01.2024	21.823.275	0,43
30.439.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	5,13 %	13.10.2027	31.070.883	0,61
11.633.000	Franshion Brilliant Ltd*	3,20 %	09.04.2026	9.779.814	0,19
14.143.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	14.224.464	0,28
5.954.970	Genneia SA*	8,75 %	02.09.2027	5.828.427	0,11
14.000.000	Geopark Ltd**	5,50 %	17.01.2027	12.058.557	0,24
4.500.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	5,13 %	15.05.2024	4.466.893	0,09
9.244.400	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	8.017.682	0,16
10.790.000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd*	5,50 %	06.04.2025	10.130.756	0,20
20.370.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA*	5,50 %	29.04.2026	19.690.253	0,38
35.576.000	Gulf International Bank BSC*	2,38 %	23.09.2025	32.551.755	0,64
5.200.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,13 %	18.05.2025	4.837.851	0,09

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
9.395.000	Hana Bank*	3,25 %	30.03.2027	8.764.291	0,17
2.500.000	Harvest Operations Corp*	4,20 %	01.06.2023	2.492.951	0,05
1.551.000	Hengjian International Investment Ltd*	1,88 %	23.06.2025	1.414.895	0,03
18.193.000	Hikma Finance USA LLC*	3,25 %	09.07.2025	16.942.689	0,33
4.995.000	Horse Gallop Finance Ltd*	1,70 %	28.07.2025	4.562.596	0,09
16.769.000	HPHT Finance 19 Ltd*	2,88 %	05.11.2024	16.018.934	0,31
6.250.000	HPHT Finance 21 II Ltd*	1,50 %	17.09.2026	5.469.313	0,11
3.023.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	2,13 %	30.09.2023	2.909.644	0,06
10.365.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,25 %	13.11.2024	9.572.913	0,19
9.858.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75 %	29.05.2024	9.373.514	0,18
3.478.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	5,82 %	24.02.2023	3.467.017	0,07
400.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	379.526	0,01
11.362.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38 %	01.06.2028	10.850.066	0,21
1.000.000	Hyundai Capital America**	1,65 %	17.09.2026	880.167	0,02
5.000.000	Hyundai Capital America**	2,38 %	10.02.2023	4.988.945	0,10
8.100.000	Hyundai Capital America**	2,65 %	10.02.2025	7.624.091	0,15
14.000.000	Hyundai Capital America**	3,40 %	20.06.2024	13.518.561	0,26
2.400.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	1,25 %	02.08.2024	2.253.516	0,04
14.419.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	1,75 %	25.08.2025	13.130.660	0,26
2.200.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	1,75 %	02.08.2026	1.971.321	0,04
8.640.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	2,25 %	02.11.2026	7.807.018	0,15
7.800.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	2,70 %	27.01.2027	7.172.841	0,14
769.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	5,71 %	15.05.2023	769.346	0,01
5.400.000	IHS Holding Ltd**	5,63 %	29.11.2026	4.523.388	0,09
6.200.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	5.478.883	0,11
9.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd*	1,00 %	09.09.2023	8.768.249	0,17
788.000	Inkia Energy Ltd*	5,88 %	09.11.2027	745.910	0,01
5.200.000	Inventive Global Investments Ltd*	1,10 %	01.09.2024	4.857.109	0,09
7.150.000	Inventive Global Investments Ltd*	1,50 %	15.07.2023	7.008.465	0,14
2.300.000	Itau Unibanco Holding SA**	2,90 %	24.01.2023	2.297.666	0,04
2.031.000	Itau Unibanco Holding SA**	3,25 %	24.01.2025	1.965.937	0,04
10.411.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc**	2,50 %	15.01.2027	9.121.181	0,18
4.996.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc**	5,13 %	01.02.2028	4.741.851	0,09
11.877.000	JSW Steel Ltd*	5,95 %	18.04.2024	11.726.899	0,23
8.439.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	7.773.816	0,15
4.118.000	KazMunayGas National Co JSC*	4,75 %	24.04.2025	4.000.807	0,08
8.632.000	KazMunayGas National Co JSC*	4,75 %	19.04.2027	7.951.468	0,15
4.362.000	Kenbourne Invest SA**	6,88 %	26.11.2024	4.159.625	0,08
5.399.000	KOC Holding AS*	5,25 %	15.03.2023	5.396.740	0,11
6.079.000	Kookmin Bank*	1,38 %	06.05.2026	5.420.222	0,11



## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
5.000.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	4.270.400	0,08
3.775.000	KT Corp*	4,00 %	08.08.2025	3.675.859	0,07
19.192.000	Leader Goal International Ltd*	4,25 %	29.12.2049	19.183.678	0,37
7.651.000	Legend Fortune Ltd*	1,38 %	02.06.2024	7.234.350	0,14
3.000.000	Levc Finance Ltd*	1,38 %	25.03.2024	2.856.022	0,06
24.990.159	Leviathan Bond Ltd*	5,75 %	30.06.2023	24.967.137	0,49
21.436.552	Leviathan Bond Ltd*	6,13 %	30.06.2025	21.012.643	0,41
31.718.000	Mashreqbank PSC*	4,25 %	26.02.2024	31.201.219	0,61
20.500.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	2,50 %	07.11.2024	19.617.882	0,38
5.000.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	2,75 %	11.05.2023	4.955.053	0,10
9.800.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	3,00 %	19.04.2024	9.533.860	0,19
14.708.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	3,00 %	28.03.2027	13.776.616	0,27
6.939.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38 %	30.01.2027	6.283.904	0,12
11.200.000	MEGlobal Canada ULC*	5,00 %	18.05.2025	11.027.856	0,21
4.265.000	Meituan*	2,13 %	28.10.2025	3.777.289	0,07
7.638.000	Melco Resorts Finance Ltd**	4,88 %	06.06.2025	7.027.399	0,14
10.678.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,25 %	26.04.2026	9.413.532	0,18
4.322.000	MercadoLibre Inc**	2,38 %	14.01.2026	3.882.539	0,08
3.200.000	MGM China Holdings Ltd*	5,25 %	18.06.2025	3.014.457	0,06
11.983.000	Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV*	3,25 %	17.04.2024	11.630.802	0,23
25.648.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38 %	29.12.2049	24.686.200	0,48
8.054.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	4,76 %	11.11.2024	7.861.169	0,15
9.178.000	Muthoot Finance Ltd*	4,40 %	02.09.2023	9.041.826	0,18
17.721.000	NBK SPC Ltd*	1,63 %	15.09.2027	15.617.517	0,30
12.700.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	11.911.076	0,23
12.646.000	NPC Ukrenergo*	6,88 %	09.11.2028	2.292.416	0,04
18.000.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	7,63 %	07.11.2024	18.354.912	0,36
7.274.000	Orazul Energy Peru SA*	5,63 %	28.04.2027	6.567.767	0,13
9.038.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	8.470.830	0,17
2.171.000	Perusahaan Gas Negara Tbk PT*	5,13 %	16.05.2024	2.156.911	0,04
11.570.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III*	4,40 %	06.06.2027	11.462.987	0,22
8.100.000	Petrobras Global Finance BV*	6,00 %	27.01.2028	8.069.423	0,16
1.933.000	Petroleos Mexicanos**	6,49 %	23.01.2027	1.765.810	0,03
52.992.000	Petroleos Mexicanos*	6,50 %	13.03.2027	48.451.248	0,95
6.000.000	Petroleos Mexicanos**	6,88 %	04.08.2026	5.680.180	0,11
9.920.000	Philippine National Bank*	3,28 %	27.09.2024	9.377.963	0,18
10.864.000	POSCO*	4,38 %	04.08.2025	10.519.847	0,21
5.571.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd*	3,08 %	29.12.2049	5.136.462	0,10
52.245.000	QatarEnergy Trading LLC*	1,38 %	12.09.2026	46.405.106	0,91
8.561.000	QIB Sukuk Ltd*	1,95 %	27.10.2025	7.823.350	0,15

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
35.321.000	QIB Sukuk Ltd*	3,98 %	26.03.2024	34.743.325	0,68
6.495.000	QIIB Senior Sukuk Ltd*	4,26 %	05.03.2024	6.408.725	0,12
49.347.000	QNB Finance Ltd*	2,63 %	12.05.2025	46.710.637	0,91
35.190.000	QNB Finance Ltd*	3,50 %	28.03.2024	34.483.490	0,67
8.700.000	Rakfunding Cayman Ltd*	4,13 %	09.04.2024	8.559.643	0,17
10.015.890	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3**	5,84 %	30.09.2027	10.093.012	0,20
21.644.900	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3**	6,33 %	30.09.2027	21.892.813	0,43
14.385.000	REC Ltd*	3,38 %	25.07.2024	13.804.636	0,27
18.625.000	REC Ltd*	3,50 %	12.12.2024	17.844.794	0,35
6.000.000	REC Ltd*	4,75 %	19.05.2023	5.974.410	0,12
5.000.000	REC Ltd*	5,25 %	13.11.2023	4.973.487	0,10
3.000.000	Republic of Angola Via Avenir II BV*	9,69 %	07.12.2023	2.955.000	0,06
6.428.571	Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC*	6,93 %	19.02.2027	5.901.703	0,11
779.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd*	6,70 %	30.09.2024	693.310	0,01
2.000.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd*	5,20 %	12.01.2026	1.445.256	0,03
25.000.000	Rongshi International Finance Ltd*	3,25 %	21.05.2024	24.395.756	0,48
20.000.000	SA Global Sukuk Ltd*	1,60 %	17.06.2026	17.902.000	0,35
7.000.000	Sands China Ltd**	4,30 %	08.01.2026	6.469.057	0,13
5.799.000	Sands China Ltd*	5,63 %	08.08.2025	5.551.917	0,11
40.650.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88 %	27.03.2024	39.867.272	0,78
3.239.000	Saudi Arabian Oil Co*	1,25 %	24.11.2023	3.120.653	0,06
4.319.000	Saudi Arabian Oil Co*	1,63 %	24.11.2025	3.945.242	0,08
45.986.000	Saudi Arabian Oil Co*	2,88 %	16.04.2024	44.635.161	0,87
26.331.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,22 %	27.01.2024	26.099.287	0,51
26.370.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 5*	1,74 %	17.09.2025	24.328.145	0,47
5.000.000	Severstal OAO Via Steel Capital SA*	5,90 %	17.12.2023	500.000	0,01
4.507.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	2,38 %	17.11.2026	4.056.579	0,08
10.581.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	1,35 %	10.01.2026	9.462.200	0,18
12.157.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	11.709.258	0,23
4.400.000	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd**	4,38 %	10.04.2024	4.364.516	0,08
5.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd*	3,25 %	28.04.2025	4.838.995	0,09
21.866.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd**	1,45 %	08.01.2026	19.871.896	0,39
23.800.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,15 %	13.05.2025	22.207.947	0,43
27.104.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,50 %	08.08.2024	26.111.045	0,51
7.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,50 %	12.11.2024	6.704.740	0,13
23.418.000	SNB Funding Ltd*	2,75 %	02.10.2024	22.419.447	0,44
17.918.000	SNB Sukuk Ltd*	2,34 %	19.01.2027	16.294.790	0,32
53.000.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88 %	24.03.2026	54.587.554	1,06
10.717.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25 %	24.06.2030	1.915.021	0,04
5.353.000	State Grid Europe Development (2014) Plc*	3,13 %	07.04.2025	5.157.669	0,10

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 68,84 % (31. Dezember 2021: 68,85 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
69.930.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	4,75 %	13.03.2023	69.686.494	1,36
10.925.000	Stillwater Mining Co*	4,00 %	16.11.2026	9.661.480	0,19
12.200.000	Studio City Finance Ltd*	6,00 %	15.07.2025	10.596.978	0,21
16.062.000	SURA Asset Management SA**	4,88 %	17.04.2024	16.034.373	0,31
2.000.000	Tencent Holdings Ltd*	1,81 %	26.01.2026	1.804.166	0,04
26.847.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	2,63 %	15.08.2025	23.061.305	0,45
6.587.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,75 %	09.05.2027	5.962.221	0,12
9.838.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,13 %	31.01.2025	9.798.845	0,19
14.200.000	Trust Fibra Uno**	5,25 %	15.12.2024	14.021.790	0,27
8.235.000	Trust Fibra Uno*	5,25 %	30.01.2026	7.960.939	0,16
9.021.000	TSMC Arizona Corp*	3,88 %	22.04.2027	8.686.154	0,17
1.200.000	Tullow Oil Plc**	7,00 %	01.03.2025	726.117	0,01
1.761.000	Tullow Oil Plc*	10,25 %	15.05.2026	1.415.527	0,02
6.400.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50 %	18.10.2024	6.149.401	0,12
4.145.000	Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS*	6,00 %	23.01.2025	3.982.412	0,08
9.530.000	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*	6,95 %	14.03.2026	9.318.663	0,18
12.723.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,50 %	01.10.2026	11.424.491	0,22
14.453.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	6,50 %	08.01.2026	13.689.516	0,27
20.058.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75 %	01.10.2026	19.978.634	0,39
20.200.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	17.617.276	0,34
15.400.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13 %	31.05.2023	14.468.825	0,28
5.000.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	1.962.326	0,04
3.239.000	Weibo Corp*	3,50 %	05.07.2024	3.139.443	0,06
8.638.000	Wynn Macau Ltd*	4,88 %	01.10.2024	8.169.110	0,16
8.889.000	Xingsheng BVI Co Ltd*	1,38 %	25.08.2024	8.322.771	0,16
29.418.000	XP Inc**	3,25 %	01.07.2026	26.475.317	0,52
19.701.875	YPF SA*	8,50 %	23.03.2025	18.003.966	0,35
6.494.000	Yunda Holding Investment Ltd*	2,25 %	19.08.2025	5.751.477	0,11
12.868.000	Zhejiang Seaport International Co Ltd*	1,98 %	17.03.2026	11.739.142	0,23
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>3.486.415.742</b>	<b>68,03</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>3.527.685.607</b>	<b>68,84</b>
<b>Staatsanleihen 23,53 % (31. Dezember 2021: 25,74 %)</b>					
<b>Euro</b>					
5.000.000	Colombia Government International Bond*	3,88 %	22.03.2026	5.030.315	0,10
46.440.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	11.04.2025	44.349.838	0,87
41.167.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	16.04.2026	36.655.478	0,72

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 23,53 % (31. Dezember 2021: 25,74 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
4.819.000	Hungary Government International Bond*	5,00 %	22.02.2027	5.112.267	0,10
17.240.000	Indonesia Government International Bond*	1,75 %	24.04.2025	17.600.479	0,34
30.745.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,13 %	15.06.2025	31.693.475	0,62
15.000.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,25 %	22.03.2030	13.565.184	0,26
11.000.000	Kazakhstan Government International Bond*	0,60 %	30.09.2026	10.345.294	0,20
10.000.000	Peruvian Government International Bond*	2,75 %	30.01.2026	10.134.019	0,20
2.376.000	Romanian Government International Bond*	2,75 %	26.02.2026	2.401.536	0,05
16.000.000	Romanian Government International Bond**	2,88 %	26.05.2028	14.820.370	0,29
2.624.000	Romanian Government International Bond*	5,00 %	27.09.2026	2.823.154	0,05
18.500.000	Senegal Government International Bond*	4,75 %	13.03.2028	17.087.804	0,33
13.740.000	Serbia International Bond*	3,13 %	15.05.2027	12.662.535	0,25
6.000.000	Ukraine Government International Bond**	6,75 %	20.06.2028	1.187.369	0,02
<b>Euro insgesamt</b>				<b>225.469.117</b>	<b>4,40</b>
<b>US-Dollar</b>					
21.984.000	Airport Authority*	1,75 %	12.01.2027	19.778.221	0,39
7.396.000	Airport Authority*	2,10 %	29.12.2049	6.745.735	0,13
53.460.000	Angolan Government International Bond*	8,25 %	09.05.2028	48.917.557	0,95
71.573.310	Argentine Republic Government International Bond*	0,50 %	09.07.2030	19.481.513	0,38
30.845.329	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	8.265.235	0,16
18.190.000	Bahamas Government International Bond*	6,00 %	21.11.2028	14.064.951	0,27
5.000.000	Bermuda Government International Bond*	3,72 %	25.01.2027	4.831.250	0,09
17.791.000	Chile Government International Bond*	2,75 %	31.01.2027	16.392.890	0,32
67.662.000	Colombia Government International Bond*	3,88 %	25.04.2027	60.114.493	1,17
24.500.000	Colombia Government International Bond*	4,50 %	28.01.2026	23.107.152	0,45
30.500.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25 %	23.10.2023	27.443.634	0,54
21.000.000	Dominican Republic International Bond*	5,50 %	27.01.2025	20.867.101	0,41
8.500.000	Dominican Republic International Bond*	5,95 %	25.01.2027	8.347.091	0,16
21.000.000	Dominican Republic International Bond*	6,88 %	29.01.2026	21.243.194	0,41
31.050.000	Dominican Republic International Bond*	8,63 %	20.04.2027	32.402.392	0,63
39.598.882	Ecuador Government International Bond*	5,50 %	31.07.2030	25.642.988	0,50
29.461.000	Egypt Government International Bond*	5,75 %	29.05.2024	28.173.905	0,55
20.779.000	Egypt Government International Bond*	5,80 %	30.09.2027	17.266.383	0,34
12.523.000	El Salvador Government International Bond*	7,75 %	24.01.2023	12.209.925	0,24
6.760.000	El Salvador Government International Bond*	8,63 %	28.02.2029	3.021.715	0,06
10.909.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	4,63 %	12.04.2027	10.345.757	0,20
18.600.000	Ghana Government International Bond*	6,38 %	11.02.2027	7.232.052	0,14
24.934.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	17.670.726	0,35
15.171.109	Honduras Government International Bond*	7,50 %	15.03.2024	15.125.595	0,30

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Staatsanleihen 23,53 % (31. Dezember 2021: 25,74 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
15.655.000	Istanbul Metropolitan Municipality*	6,38 %	09.12.2025	13.916.192	0,27
28.609.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,38 %	23.07.2024	27.595.272	0,54
28.300.297	Ivory Coast Government International Bond*	5,75 %	31.12.2032	26.837.313	0,52
35.100.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,38 %	03.03.2028	34.082.598	0,67
15.000.000	Korea Development Bank*	3,25 %	19.02.2024	14.719.459	0,29
5.600.000	Korea Electric Power Corp*	3,63 %	14.06.2025	5.362.962	0,10
4.325.000	Korea Expressway Corp*	1,13 %	17.05.2026	3.842.399	0,08
2.800.000	Korea Expressway Corp**	3,63 %	18.05.2025	2.702.993	0,05
34.802.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*	1,75 %	15.04.2026	30.854.409	0,60
17.778.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*	4,00 %	18.04.2023	17.707.574	0,35
29.086.000	Korea National Oil Corp*	1,75 %	18.04.2025	26.867.551	0,52
12.000.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	10.380.873	0,20
1.000.000	Mongolia Government International Bond*	8,75 %	09.03.2024	970.004	0,02
25.324.000	Oman Government International Bond*	4,13 %	17.01.2023	25.301.766	0,49
3.200.000	Oman Government International Bond*	4,75 %	15.06.2026	3.101.636	0,06
14.764.000	Oman Government International Bond*	4,88 %	01.02.2025	14.528.036	0,28
16.000.000	Oman Government International Bond*	5,38 %	08.03.2027	15.720.402	0,31
4.300.000	Oman Government International Bond*	6,75 %	28.10.2027	4.470.688	0,09
3.827.964	Provincia de Cordoba*	6,88 %	10.12.2025	3.105.436	0,06
7.000.000	Provincia de Mendoza Argentina*	4,25 %	19.03.2029	5.324.095	0,10
41.361.000	Qatar Government International Bond*	3,38 %	14.03.2024	40.575.239	0,79
9.800.000	Qatar Government International Bond*	3,40 %	16.04.2025	9.535.364	0,19
37.793.000	Qatar Government International Bond*	3,88 %	23.04.2023	37.640.280	0,73
2.000.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	5,13 %	01.09.2029	1.896.749	0,04
9.000.000	Republic of Kenya Government International Bond*	6,88 %	24.06.2024	8.290.999	0,16
15.400.000	Republic of Kenya Government International Bond*	7,00 %	22.05.2027	13.847.775	0,27
31.971.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,50 %	16.11.2027	32.907.878	0,64
20.000.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,88 %	16.09.2025	20.102.563	0,39
14.100.000	Romania*	3,00 %	27.02.2027	12.538.284	0,25
36.381.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,75 %	18.04.2023	11.549.399	0,23
15.000.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,88 %	21.02.2023	4.952.067	0,10
21.600.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,35 %	28.06.2024	6.884.924	0,13
27.037.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	8.611.854	0,17
13.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2025	2.968.875	0,06
11.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2026	2.399.980	0,05
14.819.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	3.247.213	0,06
4.975.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2028	1.075.844	0,02
4.059.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	884.623	0,02

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 23,53 % (31. Dezember 2021: 25,74 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
19.500.000	Ukraine Government International Bond*	8,99 %	01.02.2026	4.365.562	0,09
	<b>US-Dollar insgesamt</b>			<b>980.358.585</b>	<b>19,13</b>
	<b>Staatsanleihen insgesamt</b>			<b>1.205.827.702</b>	<b>23,53</b>
Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung			Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Investmentfonds 1,37 % (31. Dezember 2021: 1,05 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
655.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund			70.347.000	1,37
	<b>Investmentfonds insgesamt <sup>#</sup></b>			<b>70.347.000</b>	<b>1,37</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>			<b>4.854.935.976</b>	<b>94,74</b>

Devisenterminkontrakte 0,91 % (31. Dezember 2021: 0,31 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
2.632.560 AUD	1.771.811 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	18.636	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CAD</i>						
41.703 CAD	30.586 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Canada	1	210	0,00
4.380.588 CAD	3.213.478 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	21.357	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
96.841.266 CHF	104.211.633 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	1.266.613	0,02
940.398 CHF	1.014.744 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	8	9.527	0,00
5.215.622 US\$	4.784.245 CHF	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	4.684	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
10.215.442 €	10.787.067 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	168.124	0,00
1.668.836.600 €	1.766.360.073 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	23.325.012	0,46
30.108.368 €	32.013.196 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	16	275.462	0,01
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
1.508.574 US\$	1.230.779 £	15.03.2023	Westpac Banking Corp	9	25.437	0,00
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
94.969.776.524 ¥	705.670.264 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	20.961.392	0,41
1.085.611.011 ¥	8.054.100 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	5	252.115	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
3.797 SEK	364 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	1	0,00
21.989 US\$	223.083 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	492	0,00

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,91 % (31. Dezember 2021: 0,31 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
40.788.070 SGD	30.074.921 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	20	371.002	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>46.700.064</b>	<b>0,91</b>
					<b>Zeitwert % des Nettovermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>4.901.636.040</b>	<b>95,65</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte (0,04 %) (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Kapitalbetrag US\$	Beschreibung	Zinsaufwand/ (Zins-einnahmen)	Fälligkeitsdatum*	Zeitwert US\$	Vertragliche Restlaufzeit der Vereinbarung*	% des Nettovermögens
1.843.240	Citigroup Reverse Repurchase Agreement, collateralised by Sri Lanka Government International Bond, 5.88%, maturing on 21/02/2023	(2,50) %	Open/Demand	(1.843.240)	Overnight and Continuous	(0,04)
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>∞</sup></b>				<b>(1.843.240)</b>		<b>(0,04)</b>

\* Offene umgekehrte Pensionsgeschäfte ohne ein bestimmtes Fälligkeitsdatum. Jede Partei kann die Vereinbarung auf Verlangen kündigen.

### Devisenterminkontrakte (0,47 %) (31. Dezember 2021: (0,26 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
308.201.916 US\$	294.100.114 €	05.01.2023	Citibank NA	3	(5.698.738)	(0,11)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
70 US\$	104 AUD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
11.826 CHF	12.949 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(68)	(0,00)
13.305.304 US\$	12.304.646 CHF	15.03.2023	Westpac Banking Corp	8	(96.756)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
309.826 €	332.349 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(87)	(0,00)
23.351.891 US\$	22.114.434 €	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(363.955)	(0,01)
217.411.269 US\$	205.478.903 €	15.03.2023	UBS AG	1	(2.947.350)	(0,06)
20.325.894 US\$	19.051.023 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	17	(104.704)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
624.651.748 £	766.588.242 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	(13.858.832)	(0,27)
31.474.005 £	38.453.125 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	18	(525.738)	(0,01)
51.266 US\$	42.546 £	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,47 %) (31. Dezember 2021: (0,26 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
11.667.819 US\$	1.574.983.375 ¥	15.03.2023	Westpac Banking Corp	4	(382.676)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
15.909.775 SEK	1.539.797 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	3	(6.680)	(0,00)
10.160 SEK	982 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(2)	(0,00)
1.116 US\$	11.611 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
1.380.141 SGD	1.030.624 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(429)	(0,00)
70.452 US\$	95.390 SGD	15.03.2023	Westpac Banking Corp	10	(751)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(23.986.773)</b>	<b>(0,47)</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(25.830.013)</b>	<b>(0,51)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>4.875.806.027</b>	<b>95,14</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>248.855.723</b>	<b>4,86</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>5.124.661.750</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	4.154.268.120	80,13
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	566.330.269	10,92
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	63.990.587	1,23
μ Investmentfonds	70.347.000	1,36
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	20.870.051	0,40
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>4.875.806.027</b>	<b>94,04</b>



## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Schatzwechsel 1,94 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
5.525.000	United States Treasury Bill	0,00 %	22.06.2023	5.406.916	0,97
5.635.000	United States Treasury Bill	0,00 %	30.11.2023	5.403.147	0,97
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>10.810.063</b>	<b>1,94</b>
<b>Unternehmensanleihen 85,85 % (31. Dezember 2021: 87,15 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
3.510.000	Adient Global Holdings Ltd**	4,88 %	15.08.2026	3.272.864	0,59
600.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	566.652	0,10
900.000	AerCap Holdings NV*	5,88 %	10.10.2079	820.719	0,15
1.570.000	Air Canada**	3,88 %	15.08.2026	1.393.269	0,25
790.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,25 %	15.03.2026	721.768	0,13
530.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,63 %	15.01.2027	493.467	0,09
3.145.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	4,25 %	15.10.2027	2.821.624	0,51
5.675.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	5.113.232	0,92
2.995.000	Ally Financial Inc*	5,75 %	20.11.2025	2.904.552	0,52
3.825.000	Altice France SA**	8,13 %	01.02.2027	3.491.995	0,63
10.680.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	10.289.128	1,85
465.000	Amsted Industries Inc**	5,63 %	01.07.2027	442.966	0,08
500.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75 %	01.03.2027	473.539	0,09
4.635.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	7,88 %	15.05.2026	4.698.505	0,84
7.900.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	7.616.390	1,37
4.205.000	Aramark Services Inc**	6,38 %	01.05.2025	4.161.857	0,75
2.885.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	2.827.849	0,51
1.460.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	4,13 %	15.08.2026	1.267.664	0,23
1.870.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	30.04.2025	1.782.649	0,32
2.695.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	2.019.423	0,36
3.605.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	3.502.508	0,63
770.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25 %	31.12.2028	755.759	0,14
2.730.000	ASGN Inc**	4,63 %	15.05.2028	2.476.028	0,45
5.295.000	AssuredPartners Inc**	7,00 %	15.08.2025	5.129.070	0,92
3.760.000	Avient Corp**	5,75 %	15.05.2025	3.672.468	0,66
1.445.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,75 %	15.07.2027	1.312.898	0,24
1.360.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc 144A**	5,75 %	15.07.2027	1.232.371	0,22
3.470.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	5,25 %	15.05.2024	3.402.810	0,61
3.280.000	Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**	4,75 %	15.06.2027	3.037.116	0,55
1.885.000	Ball Corp*	4,00 %	15.11.2023	1.850.597	0,33
780.000	Ball Corp**	6,88 %	15.03.2028	802.207	0,14
5.355.000	Banjijay Entertainment SASU*	5,38 %	01.03.2025	5.068.936	0,91
3.435.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63 %	01.05.2027	3.084.733	0,55
3.885.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,50 %	15.11.2026	3.635.577	0,65

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 85,85 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
1.290.000	Berry Global Inc**	4,50 %	15.02.2026	1.234.545 0,22
3.485.000	Blackstone Mortgage Trust Inc**	3,75 %	15.01.2027	3.001.122 0,54
3.550.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	7,63 %	15.12.2025	3.527.986 0,63
550.000	Buckeye Partners LP**	4,13 %	01.03.2025	524.675 0,09
6.015.000	Buckeye Partners LP**	4,13 %	01.12.2027	5.271.844 0,95
1.845.000	Buckeye Partners LP**	4,15 %	01.07.2023	1.815.511 0,33
980.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	900.547 0,16
1.850.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,00 %	01.03.2023	1.843.095 0,33
1.270.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	1.155.948 0,21
3.485.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,13 %	01.05.2027	3.255.931 0,59
2.953.000	CD&R Smokey Buyer Inc**	6,75 %	15.07.2025	2.548.793 0,46
1.280.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op*	5,38 %	15.04.2027	1.224.384 0,22
2.035.000	Chesapeake Energy Corp**	5,50 %	01.02.2026	1.966.370 0,35
1.340.000	Chesapeake Energy Corp**	6,75 %	15.04.2029	1.306.433 0,23
4.705.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00 %	15.03.2026	4.293.313 0,77
2.610.000	Clarios Global LP**	6,75 %	15.05.2025	2.619.843 0,47
1.626.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	6,25 %	15.05.2026	1.591.792 0,29
1.730.000	Colgate Energy Partners III LLC**	7,75 %	15.02.2026	1.686.559 0,30
350.000	CommScope Inc**	8,25 %	01.03.2027	271.803 0,05
563.000	CommScope Technologies LLC**	6,00 %	15.06.2025	513.490 0,09
2.075.000	Consensus Cloud Solutions Inc**	6,00 %	15.10.2026	1.949.474 0,35
2.150.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	2.041.773 0,37
185.000	Coty Inc**	6,50 %	15.04.2026	177.887 0,03
1.600.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp**	5,63 %	01.05.2027	1.490.752 0,27
385.000	Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp*	5,75 %	01.04.2025	375.190 0,07
5.195.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	4.844.338 0,87
1.285.000	CSC Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2027	1.080.719 0,19
1.845.000	Dana Inc*	5,38 %	15.11.2027	1.714.625 0,31
1.540.000	DISH DBS Corp**	5,88 %	15.11.2024	1.434.193 0,26
3.575.000	DISH Network Corp**	2,38 %	15.03.2024	3.234.481 0,58
2.620.000	DISH Network Corp**	3,38 %	15.08.2026	1.647.980 0,30
195.000	Energizer Holdings Inc**	6,50 %	31.12.2027	185.823 0,03
3.040.000	EnerSys**	5,00 %	30.04.2023	3.038.298 0,55
1.385.000	EnLink Midstream Partners LP*	4,15 %	01.06.2025	1.311.274 0,24
3.656.000	EPR Properties*	4,50 %	01.04.2025	3.471.131 0,62
1.870.000	EQM Midstream Partners LP*	4,00 %	01.08.2024	1.800.230 0,32
3.280.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00 %	01.07.2025	3.170.831 0,57
1.505.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	1.475.780 0,27

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 85,85 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.705.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	2.638.458	0,47
660.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,70 %	10.08.2026	573.969	0,10
2.705.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,37 %	17.11.2023	2.642.167	0,47
2.440.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,38 %	13.11.2025	2.210.110	0,40
970.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,66 %	08.09.2024	925.618	0,17
3.830.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,13 %	16.06.2025	3.690.364	0,66
1.295.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,58 %	18.03.2024	1.280.820	0,23
870.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,35 %	04.11.2027	893.664	0,16
2.350.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	15.10.2027	2.187.310	0,39
6.730.000	Garda World Security Corp**	4,63 %	15.02.2027	5.954.031	1,07
1.280.000	Gen Digital Inc**	5,00 %	15.04.2025	1.247.961	0,22
705.000	Gen Digital Inc**	6,75 %	30.09.2027	691.817	0,12
7.460.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	7.055.817	1,27
1.365.000	GFL Environmental Inc**	3,75 %	01.08.2025	1.292.075	0,23
5.324.170	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50 %	15.09.2024	4.536.991	0,82
1.560.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	4,88 %	15.03.2027	1.429.256	0,26
730.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	31.05.2026	689.793	0,12
2.690.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	9,50 %	31.05.2025	2.768.366	0,50
1.355.000	Graphic Packaging International LLC**	4,75 %	15.07.2027	1.277.494	0,23
2.230.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00 %	15.05.2027	2.139.596	0,38
2.715.000	Hanesbrands Inc**	4,63 %	15.05.2024	2.633.978	0,47
4.840.000	Harsco Corp**	5,75 %	31.07.2027	3.829.149	0,69
2.670.000	Hertz Corp**	4,63 %	01.12.2026	2.239.463	0,40
1.350.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25 %	01.11.2028	1.224.146	0,22
2.435.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	6,75 %	15.01.2027	2.337.103	0,42
3.465.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	3.151.624	0,57
1.320.000	IAA Inc**	5,50 %	15.06.2027	1.289.738	0,23
2.825.000	iHeartCommunications Inc**	6,38 %	01.05.2026	2.603.464	0,47
650.000	IHO Verwaltungs GmbH**	4,75 %	15.09.2026	563.513	0,10
1.035.000	Iliad Holding SASU**	6,50 %	15.10.2026	961.705	0,17
4.255.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc*	3,38 %	15.01.2026	3.914.579	0,70
7.875.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2027	7.254.686	1,30
875.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc**	7,75 %	15.10.2025	806.383	0,14
5.530.000	JELD-WEN Inc**	4,63 %	15.12.2025	4.639.006	0,83
4.490.000	KAR Auction Services Inc**	5,13 %	01.06.2025	4.393.419	0,79
2.800.000	KB Home*	6,88 %	15.06.2027	2.821.476	0,51
1.570.000	Legacy LifePoint Health LLC**	4,38 %	15.02.2027	1.330.418	0,24
2.415.000	Legacy LifePoint Health LLC**	6,75 %	15.04.2025	2.276.548	0,41

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 85,85 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.980.000	Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc**	5,00 %	01.02.2026	2.655.925	0,48
1.490.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	1.243.033	0,22
1.080.000	LFS Topco LLC**	5,88 %	15.10.2026	872.869	0,16
3.275.000	Lindblad Expeditions LLC**	6,75 %	15.02.2027	2.975.076	0,53
1.420.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,75 %	15.10.2027	1.266.463	0,23
3.425.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88 %	01.11.2024	3.321.546	0,60
1.580.000	Live Nation Entertainment Inc**	5,63 %	15.03.2026	1.496.637	0,27
2.795.000	LPL Holdings Inc**	4,63 %	15.11.2027	2.615.564	0,47
1.230.000	Lumen Technologies Inc**	4,00 %	15.02.2027	1.045.109	0,19
785.000	Mattamy Group Corp**	5,25 %	15.12.2027	697.538	0,13
2.695.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,25 %	15.04.2025	2.497.663	0,45
905.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	761.861	0,14
1.090.000	Meritage Homes Corp*	5,13 %	06.06.2027	1.026.701	0,18
1.310.000	Meritage Homes Corp*	6,00 %	01.06.2025	1.305.950	0,23
2.695.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	2.271.238	0,41
4.130.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,25 %	01.08.2026	3.768.233	0,68
635.000	NCL Corp Ltd**	3,63 %	15.12.2024	543.521	0,10
1.068.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.02.2027	926.442	0,17
2.255.000	New Fortress Energy Inc**	6,50 %	30.09.2026	2.098.503	0,38
3.650.000	New Fortress Energy Inc**	6,75 %	15.09.2025	3.460.638	0,62
3.845.000	NextEra Energy Operating Partners LP**	4,25 %	15.07.2024	3.735.921	0,67
1.360.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,13 %	01.03.2028	1.307.564	0,24
1.290.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	4,75 %	30.04.2027	1.136.635	0,20
3.580.000	NuStar Logistics LP*	5,75 %	01.10.2025	3.447.731	0,62
1.510.000	NuStar Logistics LP*	6,00 %	01.06.2026	1.456.587	0,26
1.425.000	Olympus Water US Holding Corp**	7,13 %	01.10.2027	1.366.283	0,25
3.090.000	OneMain Finance Corp*	3,50 %	15.01.2027	2.562.290	0,46
2.980.000	OneMain Finance Corp**	6,13 %	15.03.2024	2.889.110	0,52
4.000.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	3.851.620	0,69
1.100.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	1.048.421	0,19
1.520.000	Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**	6,25 %	15.06.2025	1.508.215	0,27
1.375.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**	4,00 %	15.10.2027	1.221.894	0,22
4.355.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	7,50 %	01.06.2025	4.359.268	0,78
2.237.000	PDC Energy Inc**	5,75 %	15.05.2026	2.139.019	0,38
6.970.000	Performance Food Group Inc**	6,88 %	01.05.2025	6.996.416	1,26
4.820.000	Presidio Holdings Inc**	4,88 %	01.02.2027	4.402.974	0,79
1.710.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	1.588.009	0,29
4.525.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	4.365.268	0,78

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 85,85 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
3.060.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	2.791.393 0,50
1.335.000	PTC Inc**	3,63 %	15.02.2025	1.273.598 0,23
1.520.000	Range Resources Corp*	4,88 %	15.05.2025	1.446.330 0,26
350.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75 %	15.10.2027	317.296 0,06
2.660.000	RLJ Lodging Trust LP**	3,75 %	01.07.2026	2.372.277 0,43
625.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	4,25 %	01.07.2026	505.999 0,09
1.295.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	8,25 %	15.01.2029	1.303.094 0,23
1.441.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	11,50 %	01.06.2025	1.548.643 0,28
1.015.000	SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**	5,38 %	01.11.2026	861.481 0,15
1.325.000	Select Medical Corp**	6,25 %	15.08.2026	1.262.579 0,23
1.520.000	Sensata Technologies BV**	5,00 %	01.10.2025	1.487.063 0,27
1.310.000	Sensata Technologies BV**	5,63 %	01.11.2024	1.303.791 0,23
600.000	Service Properties Trust**	4,35 %	01.10.2024	546.391 0,10
330.000	Service Properties Trust**	4,75 %	01.10.2026	260.215 0,05
620.000	Service Properties Trust**	5,25 %	15.02.2026	518.835 0,09
2.200.000	Sirius XM Radio Inc**	3,13 %	01.09.2026	1.956.207 0,35
4.650.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00 %	01.08.2027	4.308.509 0,77
2.690.000	Six Flags Entertainment Corp**	4,88 %	31.07.2024	2.594.169 0,47
1.815.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	1.637.493 0,29
793.000	Six Flags Theme Parks Inc**	7,00 %	01.07.2025	799.694 0,14
3.820.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	3.804.147 0,68
1.205.000	SPCM SA**	3,13 %	15.03.2027	1.037.800 0,19
1.275.000	Spirit AeroSystems Inc**	7,50 %	15.04.2025	1.262.645 0,23
1.345.000	Sprint LLC**	7,13 %	15.06.2024	1.374.240 0,25
1.410.000	Sprint LLC**	7,63 %	15.02.2025	1.458.693 0,26
1.580.000	Sprint LLC**	7,63 %	01.03.2026	1.666.119 0,30
1.800.000	Sprint LLC**	7,88 %	15.09.2023	1.829.135 0,33
3.990.000	Standard Industries Inc**	5,00 %	15.02.2027	3.687.630 0,66
2.180.000	Starwood Property Trust Inc**	3,75 %	31.12.2024	2.049.572 0,37
1.445.000	Starwood Property Trust Inc**	4,38 %	15.01.2027	1.266.536 0,23
2.160.000	Starwood Property Trust Inc**	4,75 %	15.03.2025	2.064.894 0,37
2.160.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50 %	31.10.2026	1.755.410 0,32
7.875.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	7.045.290 1,27
2.605.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50 %	01.10.2025	2.632.548 0,47
2.755.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc**	5,63 %	01.03.2024	2.747.148 0,49
1.200.000	Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp**	5,75 %	01.06.2025	1.204.125 0,22
2.445.000	Tenet Healthcare Corp**	4,63 %	01.09.2024	2.378.293 0,43
3.710.000	TMS International Corp**	6,25 %	15.04.2029	2.662.686 0,48

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 85,85 % (31. Dezember 2021: 87,15 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.070.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	4.022.747	0,72
2.235.000	TransDigm Inc*	6,38 %	15.06.2026	2.177.817	0,39
620.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	614.412	0,11
1.350.000	TransDigm Inc**	8,00 %	15.12.2025	1.372.937	0,25
3.210.000	TransDigm UK Holdings Plc**	6,88 %	15.05.2026	3.139.584	0,56
1.600.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*	5,88 %	15.06.2024	1.594.696	0,29
780.000	Tri Pointe Homes Inc*	5,25 %	01.06.2027	697.581	0,13
2.755.000	Trident TPI Holdings Inc**	9,25 %	01.08.2024	2.637.531	0,47
1.530.000	Trinseo Materials Operating SCA/Trinseo Materials Finance Inc**	5,38 %	01.09.2025	1.260.842	0,23
5.165.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	4.747.077	0,85
1.450.000	United Airlines Holdings Inc**	4,88 %	15.01.2025	1.387.244	0,25
3.475.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	3.226.975	0,58
2.780.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,88 %	15.02.2025	2.696.942	0,48
910.000	US Acute Care Solutions LLC**	6,38 %	01.03.2026	808.693	0,15
3.030.000	US Foods Inc**	6,25 %	15.04.2025	3.003.224	0,54
1.470.000	Viasat Inc**	5,63 %	15.09.2025	1.366.170	0,25
1.350.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,25 %	01.12.2026	1.262.417	0,23
3.570.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	3.225.209	0,58
3.365.000	White Capital Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	2.913.215	0,52
3.305.000	WR Grace Holdings LLC**	4,88 %	15.06.2027	2.932.791	0,53
3.710.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	01.10.2024	3.659.507	0,66
4.720.000	XHR LP**	6,38 %	15.08.2025	4.545.561	0,82
2.095.000	Zayo Group Holdings Inc**	4,00 %	01.03.2027	1.551.808	0,28
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>477.638.711</b>	<b>85,85</b>
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 4.24 % (31. Dezember 2021: 7,18 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
785.000	Applied Systems Inc	9,10 %	19.09.2024	783.505	0,14
1.690.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/Aru Finance Corp	12,90 %	01.11.2025	1.791.400	0,32
960.000	Asurion LLC	9,60 %	20.01.2029	751.886	0,14
788.000	CQP Holdco LP	8,50 %	05.06.2028	785.538	0,14
574.763	First Brands Group LLC	8,40 %	30.03.2027	546.887	0,10
1.885.000	GIP III Stetson I LP	8,60 %	18.07.2025	1.851.428	0,33
800.000	GYP Holdings III Corp	0,00 %	01.06.2025	800.000	0,14
1.600.916	Hub International Ltd	7,50 %	25.04.2025	1.588.725	0,29
1.347.868	Mauser Packaging Solutions Holding Co	7,40 %	03.04.2024	1.318.667	0,24
4.222.190	Medline Borrower LP	7,60 %	23.10.2028	4.019.968	0,72
1.403.455	MHI Holdings LLC	9,40 %	21.09.2026	1.393.807	0,25

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 4,24 % (31. Dezember 2021: 7,18 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.540.500	MPH Acquisition Holdings LLC	9,00 %	01.09.2028	1.322.904	0,24
1.639.211	Nautilus Power LLC	8,60 %	16.05.2024	1.261.045	0,23
797.296	Nouryon Finance BV	7,20 %	01.10.2025	787.928	0,14
2.955.457	Team Health Holdings Inc	9,60 %	02.03.2027	2.235.995	0,40
792.956	TransDigm Inc	0,00 %	09.12.2025	784.828	0,14
1.572.103	UFC Holdings LLC	7,10 %	29.04.2026	1.554.416	0,28
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>				<b>23.578.927</b>	<b>4,24</b>

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Investmentfonds 0,22 % (31. Dezember 2021: 0,36 %)</b>			
<b>Britisches Pfund</b>			
1.423.570	NB Global Monthly Income Fund Ltd	1.221.039	0,22
<b>Investmentfonds insgesamt †</b>			<b>1.221.039</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>			<b>513.248.740</b>

Devisenterminkontrakte 4,13 % (31. Dezember 2021: 0,19 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht- realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
18.542 AUD	11.789 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	793	0,00
7.084 AUD	4.618 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	189	0,00
1.257.845 AUD	802.832 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	50.690	0,01
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
5.236 CHF	5.614 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	55	0,00
1.926.428 CHF	1.974.909 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	110.587	0,02
7.140 US\$	6.580 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	17	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CNY</i>						
2.617.600 CNY	371.030 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	7.749	0,00
64.565 CNY	9.049 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	293	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
404.807 €	402.610 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	29.857	0,01
313.215 €	327.401 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	7.215	0,00
122.646.056 €	122.599.033 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	59	8.427.337	1,52
23.862 US\$	22.336 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
295.234 £	335.316 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	19.961	0,00
12.447.644 £	14.017.927 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	961.278	0,17

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 4,13 % (31. Dezember 2021: 0,19 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>						
12.950.088 £	14.632.654 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	951.179	0,17
571.940 US\$	469.960 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	6.400	0,00
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
20.001 HKD	2.550 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	13	0,00
38.593 HKD	4.935 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	11	0,00
2.509.562 HKD	320.403 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	1.246	0,00
1.661 US\$	12.943 HKD	18.01.2023	UBS AG	1	3	0,00
58.738 US\$	457.515 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	99	0,00
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
135.852.068 ¥	939.517 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	92.089	0,02
328.432.725 ¥	2.391.018 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	102.968	0,01
19.641.783.650 ¥	137.047.432 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	12.104.373	2,18
883.731 US\$	115.806.854 ¥	18.01.2023	UBS AG	1	4.340	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
10.953 SGD	7.824 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	345	0,00
46.188 SGD	33.031 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	1.419	0,00
3.275.299 SGD	2.311.215 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	33	131.638	0,02
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>23.012.144</b>	<b>4,13</b>
					<b>Zeitwert % des Nettovermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>536.260.884</b>	<b>96,38</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,95 %) (31. Dezember 2021: (0,84 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
2.480.692 US\$	2.211.622 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(180.722)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
9.177 AUD	6.306 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(79)	(0,00)
18.157 US\$	27.596 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(568)	(0,00)
5.997 US\$	9.237 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(270)	(0,00)
39.250 US\$	60.123 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(1.547)	(0,00)



## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,95 %) (31. Dezember 2021: (0,84 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
928.137 US\$	906.262 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(52.956)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen CNY</i>						
82.911 US\$	584.741 CNY	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(1.704)	(0,00)
6.269 US\$	44.784 CNY	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(211)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
1.086.544 US\$	1.058.797 €	18.01.2023	UBS AG	2	(44.600)	(0,01)
60.627.657 US\$	60.673.820 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	51	(4.191.964)	(0,75)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
294.684 €	362.689 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(8.072)	(0,00)
242.969 US\$	219.076 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(20.662)	(0,00)
2.452.678 US\$	2.177.930 €	18.01.2023	UBS AG	1	(168.192)	(0,03)
2.768.876 US\$	2.448.672 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	(177.800)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
16.862 HKD	2.169 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(8)	(0,00)
296.218 HKD	38.056 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(89)	(0,00)
1.759 US\$	13.790 HKD	18.01.2023	UBS AG	1	(8)	(0,00)
2.844 US\$	22.310 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(15)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
880.236 US\$	116.986.972 ¥	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(8.116)	(0,00)
2.907.497 US\$	422.338.190 ¥	18.01.2023	UBS AG	2	(299.569)	(0,06)
2.362.716 US\$	322.815.002 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(88.612)	(0,02)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
14.528 US\$	20.377 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(670)	(0,00)
8.911 US\$	12.811 SGD	18.01.2023	UBS AG	1	(644)	(0,00)
791.558 US\$	1.114.081 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	25	(39.373)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(5.286.451)</b>	<b>(0,95)</b>
					<b>Zeitwert % des Netto-</b>	
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(5.286.451)</b>	<b>(0,95)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>530.974.433</b>	<b>95,43</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>25.399.246</b>	<b>4,57</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>556.373.679</b>	<b>100,00</b>

∞ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2022 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

## Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	74.233.517	12,92
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	414.215.257	72,10
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	23.578.927	4,10
μ Investmentfonds	1.221.039	0,21
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	17.725.693	3,09
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>530.974.433</b>	<b>92,42</b>

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Schatzwechsel 0,61 % (31. Dezember 2021: 13,15 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
8.100.000	United States Treasury Bill	0,00 %	30.03.2023	8.017.122	0,61
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>8.017.122</b>	<b>0,61</b>
<b>Agency Bonds 0,06 % (31. Dezember 2021: 0,07 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
690.000	Federal National Mortgage Association	5,63 %	15.07.2037	772.053	0,06
<b>Agency Bonds insgesamt **</b>				<b>772.053</b>	<b>0,06</b>
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 7,97 % (31. Dezember 2021: 5,20 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
4.640.000	AM Capital Funding LLC Class A	4,98 %	15.12.2023	4.583.632	0,35
3.599.000	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC Class B	3,55 %	22.09.2025	3.432.394	0,26
1.810.000	BXP Trust 2017-GM Class A	3,38 %	13.06.2039	1.614.015	0,12
1.465.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17 Class B	5,10 %	10.11.2046	1.424.491	0,11
20.051.876	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC25 Class XA	0,95 %	10.10.2047	249.110	0,02
15.122.790	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA	1,31 %	10.02.2048	309.379	0,02
5.836.876	COMM 2014-CCRE16 Mortgage Trust Class XA	0,94 %	10.04.2047	53.326	0,00
8.498.350	COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA	0,95 %	10.05.2047	75.953	0,01
23.244.673	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA	1,05 %	10.04.2047	197.231	0,01
1.780.578	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA	1,06 %	10.06.2047	17.761	0,00
13.396.388	COMM 2014-UBS6 Mortgage Trust Class XA	0,84 %	10.12.2047	162.805	0,01
2.270.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1B1	7,08 %	25.12.2041	2.137.100	0,16
3.725.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2	5,83 %	25.12.2041	3.542.855	0,27
5.195.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R03 Class 1M2	7,43 %	25.03.2042	5.267.173	0,40
2.119.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04 Class 1M2	7,03 %	25.03.2042	2.114.053	0,16
2.033.868	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R07 Class 1M1	6,89 %	25.06.2042	2.052.928	0,15
609.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R08 Class 1M2	7,53 %	25.07.2042	604.910	0,05
2.024.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1	7,99 %	25.01.2030	2.051.195	0,15
4.534.830	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	6,64 %	25.07.2030	4.492.867	0,34
5.674.923	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	6,74 %	25.01.2031	5.692.934	0,43
4.031.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2B1	9,89 %	25.09.2029	4.355.149	0,33
1.259.389	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	6,59 %	25.08.2030	1.244.737	0,09
4.184.823	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	6,94 %	25.12.2030	4.141.665	0,31
4.679.840	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	7,19 %	25.02.2030	4.735.281	0,36
3.801.698	Fannie Mae Interest Strip Class C24	4,00 %	25.08.2043	718.662	0,05
2.926.240	Fannie Mae Interest Strip Class C26	4,00 %	25.10.2041	530.651	0,04
6.683.956	Fannie Mae REMICS Class AI	3,50 %	25.11.2051	1.160.839	0,09
3.211.994	Fannie Mae REMICS Class DS	1,76 %	25.06.2043	361.188	0,03
1.995.279	Fannie Mae REMICS Class HS	1,61 %	25.06.2046	220.975	0,02

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 7,97 % (31. Dezember 2021: 5,20 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
3.451.802	Fannie Mae REMICS Class SA	1,61 %	25.09.2046	384.804	0,03
2.012.253	Fannie Mae REMICS Class SB	1,71 %	25.03.2046	188.891	0,01
3.196.631	Fannie Mae REMICS Class SN	1,71 %	25.07.2049	312.465	0,02
3.361.681	Fannie Mae REMICS Class ST	1,71 %	25.12.2044	353.587	0,03
3.298.539	Fannie Mae REMICS Class SY	1,76 %	25.07.2043	364.671	0,03
2.089.214	Freddie Mac REMICS Class BI	4,50 %	25.02.2050	358.760	0,03
1.860.074	Freddie Mac REMICS Class LI	4,00 %	25.12.2048	353.407	0,03
1.115.678	Freddie Mac REMICS Class SA	1,68 %	15.10.2046	135.531	0,01
1.715.065	Freddie Mac REMICS Class SA	1,83 %	15.03.2045	185.496	0,01
2.746.741	Freddie Mac REMICS Class SP	1,83 %	15.01.2043	317.148	0,02
3.691.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2 Class M2	7,68 %	25.02.2042	3.482.784	0,26
3.749.162	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B	6,83 %	25.04.2042	3.710.007	0,28
4.211.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M2	9,18 %	25.03.2042	4.100.422	0,31
2.635.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA3 Class M1B	7,48 %	25.08.2042	2.617.122	0,20
1.252.311	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	6,19 %	25.07.2030	1.221.977	0,09
3.553.755	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	6,69 %	25.09.2030	3.569.327	0,27
10.029.760	Government National Mortgage Association Class CI	2,00 %	20.10.2050	1.055.312	0,08
8.029.748	Government National Mortgage Association Class DI	2,50 %	20.02.2051	1.020.019	0,08
8.234.789	Government National Mortgage Association Class HS	1,85 %	20.10.2045	877.399	0,07
7.265.908	Government National Mortgage Association Class IO	2,50 %	20.11.2051	1.056.038	0,08
2.760.711	Government National Mortgage Association Class KS	1,85 %	20.07.2047	300.866	0,02
1.687.304	Government National Mortgage Association Class SA	1,77 %	16.12.2043	173.451	0,01
19.363.361	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA	1,02 %	10.01.2047	136.204	0,01
11.019.590	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26 Class XA	0,94 %	10.11.2047	152.110	0,01
9.988.677	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA	0,73 %	10.05.2050	138.154	0,01
4.468.712	Hilton Grand Vacations Trust 2018-A Class A	3,54 %	25.02.2032	4.322.454	0,33
1.748.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class C	4,19 %	05.11.2038	1.577.509	0,12
529.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class D	4,19 %	05.11.2038	467.968	0,04
1.800.000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class C	2,98 %	10.08.2038	1.527.600	0,12
2.433.000	MetroNet Infrastructure Issuer LLC Class A2	6,35 %	20.10.2052	2.318.113	0,17
1.200.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 Class C	4,56 %	15.05.2050	1.030.458	0,08
3.337.000	OneMain Financial Issuance Trust 2022-2 Class A	4,89 %	14.10.2034	3.261.505	0,25
1.865.000	Prestige Auto Receivables Trust 2022-1 Class B	6,55 %	17.07.2028	1.865.193	0,14
148.856	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2004-DO1 Class M1	5,36 %	25.07.2034	150.715	0,01
1.600.000	Sofi Professional Loan Program 2018-A LLC Class B	3,61 %	25.02.2042	1.439.186	0,11
1.391.000	Vantage Data Centers Issuer LLC Class A2	2,17 %	15.10.2046	1.198.199	0,09
1.565.360	Vantage Data Centers Issuer LLC Class A2	4,20 %	15.11.2043	1.528.091	0,12
425.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C47 Class C	4,93 %	15.09.2061	355.641	0,03
8.810.279	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA	1,00 %	15.08.2047	114.114	0,01
15.192.440	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22 Class XA	0,78 %	15.09.2057	143.640	0,01

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 7,97 % (31. Dezember 2021: 5,20 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
6.572.312	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14 Class XA	1,24 %	15.03.2047	55.762	0,00
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>105.467.359</b>	<b>7,97</b>
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %)</b>					
<b>Euro</b>					
179.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	164.740	0,01
500.000	Accor SA*	2,63 %	29.12.2049	442.970	0,03
500.000	Adient Global Holdings Ltd*	3,50 %	15.08.2024	513.263	0,04
745.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	677.456	0,05
485.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	470.395	0,04
995.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	865.147	0,07
189.000	Altice France Holding SA*	4,00 %	15.02.2028	131.155	0,01
200.000	Altice France Holding SA*	8,00 %	15.05.2027	158.220	0,01
1.200.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	984.213	0,07
100.000	Altice France SA**	4,25 %	15.10.2029	80.744	0,01
469.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	481.423	0,04
273.000	Autostrade per l'Italia SpA*	2,25 %	25.01.2032	224.268	0,02
545.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	489.989	0,04
188.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25 %	30.04.2029	174.728	0,01
415.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH**	4,38 %	15.01.2028	391.525	0,03
547.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	506.604	0,04
710.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38 %	15.05.2026	700.545	0,05
295.000	CMA CGM SA*	7,50 %	15.01.2026	326.475	0,02
496.000	Coty Inc**	4,75 %	15.04.2026	498.918	0,04
240.000	DKT Finance ApS**	7,00 %	17.06.2023	255.171	0,02
500.000	Dufry One BV**	2,00 %	15.02.2027	438.880	0,03
1.030.000	Dufry One BV*	3,38 %	15.04.2028	916.785	0,07
490.000	eG Global Finance Plc*	4,38 %	07.02.2025	456.088	0,03
100.000	eG Global Finance Plc*	6,25 %	30.10.2025	94.005	0,01
500.000	eircom Finance DAC**	3,50 %	15.05.2026	483.643	0,04
200.000	Electricite de France SA*	2,63 %	29.12.2049	167.131	0,01
400.000	Electricite de France SA*	7,50 %	29.12.2049	426.458	0,03
200.000	Faurecia SE*	2,63 %	15.06.2025	194.895	0,01
279.000	Faurecia SE*	2,75 %	15.02.2027	252.228	0,02
360.000	Gruenthal GmbH*	3,63 %	15.11.2026	353.495	0,03
495.000	IHO Verwaltungs GmbH*	3,88 %	15.05.2027	448.380	0,03
780.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	774.369	0,06
100.000	INEOS Finance Plc*	2,88 %	01.05.2026	92.346	0,01
720.000	INEOS Finance Plc*	3,38 %	31.03.2026	687.784	0,05
1.330.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc*	3,75 %	15.07.2026	1.174.610	0,09

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
670.000	Intrum AB*	3,00 %	15.09.2027	574.753	0,04
660.000	Intrum AB*	3,50 %	15.07.2026	594.949	0,05
180.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.01.2026	165.938	0,01
910.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	741.876	0,06
270.000	Kaixo Bondco Telecom SA*	5,13 %	30.09.2029	247.065	0,02
259.000	Kapla Holding SAS*	3,38 %	15.12.2026	246.627	0,02
405.000	Kronos International Inc**	3,75 %	15.09.2025	379.973	0,03
200.000	LHMC Finco 2 Sarl*	7,25 %	02.10.2025	185.204	0,01
1.705.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	1.637.727	0,12
100.000	Lorca Telecom Bondco SA 144A*	4,00 %	18.09.2027	95.884	0,01
351.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	321.798	0,02
292.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	218.762	0,02
250.000	Motion Bondco DAC*	4,50 %	15.11.2027	220.794	0,02
150.000	Motion Finco Sarl**	7,00 %	15.05.2025	160.220	0,01
395.000	Playtech Plc*	4,25 %	07.03.2026	399.654	0,03
400.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63 %	05.01.2026	403.846	0,03
159.000	Repsol International Finance BV*	4,25 %	29.12.2049	151.875	0,01
325.000	Repsol International Finance BV*	4,50 %	25.03.2075	336.515	0,03
191.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	1,00 %	12.08.2027	142.812	0,01
100.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63 %	15.03.2028	92.350	0,01
700.000	Schaeffler AG*	3,38 %	12.10.2028	654.037	0,05
375.000	SGL Carbon SE*	4,63 %	30.09.2024	398.581	0,03
373.659	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	376.530	0,03
300.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	295.363	0,02
510.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,88 %	31.03.2027	439.932	0,03
1.085.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	3,75 %	09.05.2027	1.006.443	0,08
350.000	United Group BV**	3,63 %	15.02.2028	272.365	0,02
505.000	United Group BV*	4,00 %	15.11.2027	403.967	0,03
195.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	151.182	0,01
345.000	Verisure Holding AB*	3,25 %	15.02.2027	320.893	0,02
945.000	Verisure Holding AB*	3,88 %	15.07.2026	917.124	0,07
300.000	Vivion Investments Sarl*	3,00 %	08.08.2024	252.144	0,02
284.000	WEPA Hygieneprodukte GmbH**	2,88 %	15.12.2027	248.920	0,02
800.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	654.598	0,05
300.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	270.639	0,02
1.189.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	924.606	0,07
<b>Euro insgesamt</b>				<b>30.404.992</b>	<b>2,30</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
100.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	96.666	0,01

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>					
160.000	AA Bond Co Ltd 144A*	6,50 %	31.01.2026	154.666	0,01
320.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	266.736	0,02
216.000	B&M European Value Retail SA*	3,63 %	15.07.2025	242.596	0,02
205.000	Bellis Finco Plc**	4,00 %	16.02.2027	182.148	0,01
320.000	Centrica Plc*	5,25 %	10.04.2075	353.955	0,03
1.210.000	Encore Capital Group Inc*	4,25 %	01.06.2028	1.127.932	0,08
330.000	Encore Capital Group Inc*	5,38 %	15.02.2026	357.301	0,03
100.000	Maison Finco Plc**	6,00 %	31.10.2027	88.147	0,01
140.000	National Express Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	139.465	0,01
450.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38 %	15.02.2025	471.644	0,04
137.000	Premier Foods Finance Plc*	3,50 %	15.10.2026	145.177	0,01
165.000	RAC Bond Co Plc**	5,25 %	04.11.2027	157.415	0,01
400.000	Rolls-Royce Plc*	5,75 %	15.10.2027	442.567	0,03
1.045.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	1.019.882	0,08
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>5.246.297</b>	<b>0,40</b>
<b>US-Dollar</b>					
2.545.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,00 %	15.10.2030	2.066.273	0,16
2.200.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40 %	09.03.2023	2.153.970	0,16
6.840.000	AbbVie Inc**	3,80 %	15.03.2025	6.672.119	0,50
2.400.000	ABN AMRO Bank NV**	3,32 %	13.03.2037	1.745.138	0,13
785.000	ADT Security Corp**	4,88 %	15.07.2032	668.509	0,05
791.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	747.037	0,06
3.115.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,30 %	30.01.2032	2.442.804	0,18
360.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,50 %	15.03.2029	302.828	0,02
340.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,88 %	15.02.2030	304.040	0,02
2.110.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	1.901.131	0,14
1.050.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,00 %	01.06.2029	763.413	0,06
850.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,63 %	15.07.2026	779.501	0,06
535.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl**	4,63 %	01.06.2028	442.873	0,03
590.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 144A**	4,63 %	01.06.2028	479.105	0,04
425.000	Ally Financial Inc*	5,75 %	20.11.2025	412.165	0,03
835.000	Ally Financial Inc Series B**	4,70 %	29.12.2049	561.016	0,04
875.000	Ally Financial Inc Series C**	4,70 %	29.12.2049	550.156	0,04
4.195.000	Altice France Holding SA**	6,00 %	15.02.2028	2.485.293	0,19
915.000	Altice France SA*	5,50 %	15.01.2028	718.522	0,05
595.000	AMC Networks Inc**	4,25 %	15.02.2029	371.618	0,03
5.255.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	5.062.675	0,38
4.950.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75 %	20.04.2029	4.533.016	0,34
2.035.000	American Express Co**	3,55 %	29.12.2049	1.676.840	0,13

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
3.715.000	American Tower Corp*	2,40 %	15.03.2025	3.498.034	0,26
2.495.000	Amgen Inc**	2,77 %	01.09.2053	1.512.438	0,11
1.350.000	AmWINS Group Inc**	4,88 %	30.06.2029	1.146.753	0,09
885.000	Analog Devices Inc**	2,95 %	01.10.2051	600.585	0,05
435.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75 %	15.01.2028	404.259	0,03
2.455.000	Apple Inc**	2,55 %	20.08.2060	1.497.862	0,11
1.230.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	1.020.269	0,08
490.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	472.409	0,04
1.275.000	Aramark Services Inc**	5,00 %	01.04.2025	1.246.105	0,09
1.205.000	Aramark Services Inc**	5,00 %	01.02.2028	1.126.639	0,09
45.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	4,00 %	01.09.2029	35.748	0,00
570.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	558.708	0,04
980.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	734.336	0,06
120.000	Asbury Automotive Group Inc**	4,63 %	15.11.2029	101.258	0,01
740.000	Asbury Automotive Group Inc**	5,00 %	15.02.2032	609.760	0,05
875.000	Ascension Health**	3,11 %	15.11.2039	675.627	0,05
1.295.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	1.156.344	0,09
505.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	490.643	0,04
1.355.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25 %	31.12.2028	1.329.939	0,10
1.070.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	882.043	0,07
2.030.000	AssuredPartners Inc**	7,00 %	15.08.2025	1.966.386	0,15
4.545.000	AT&T Inc**	3,50 %	15.09.2053	3.088.033	0,23
1.165.000	AT&T Inc*	3,65 %	01.06.2051	825.788	0,06
3.727.000	AT&T Inc*	4,50 %	09.03.2048	3.052.049	0,23
817.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd*	6,75 %	29.12.2049	814.747	0,06
615.000	Avient Corp**	7,13 %	01.08.2030	602.012	0,05
1.140.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38 %	01.03.2029	976.682	0,07
1.655.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,75 %	15.07.2027	1.499.687	0,11
260.000	Axalta Coating Systems LLC**	3,38 %	15.02.2029	214.861	0,02
310.000	Ball Corp*	2,88 %	15.08.2030	248.064	0,02
310.000	Ball Corp*	3,13 %	15.09.2031	249.373	0,02
1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	6,50 %	29.12.2049	960.006	0,07
800.000	Banco do Brasil SA*	6,25 %	29.12.2049	719.839	0,05
200.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,63 %	29.12.2049	187.674	0,01
1.600.000	Banco Santander SA*	5,15 %	18.08.2025	1.583.889	0,12
1.000.000	Banco Santander SA*	7,50 %	29.12.2049	979.940	0,07
9.310.000	Bank of America Corp**	1,84 %	04.02.2025	8.930.067	0,68
7.935.000	Bank of America Corp**	2,48 %	21.09.2036	5.848.547	0,44
418.000	Bank of America Corp**	4,30 %	29.12.2049	362.108	0,03
1.340.000	Bank of America Corp**	4,38 %	29.12.2049	1.138.237	0,09



## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.605.000	Bank of America Corp**	4,95 %	22.07.2028	2.548.471	0,19
3.665.000	Bank of America Corp**	5,02 %	22.07.2033	3.490.344	0,26
420.000	Bank of America Corp**	5,88 %	29.12.2049	370.402	0,03
1.095.000	Bank of America Corp**	6,13 %	29.12.2049	1.077.206	0,08
210.000	Bank of New York Mellon Corp**	3,70 %	29.12.2049	187.560	0,01
2.795.000	Bank of New York Mellon Corp**	3,75 %	29.12.2049	2.258.239	0,17
2.865.000	Barclays Plc*	4,38 %	29.12.2049	2.191.725	0,17
2.630.000	Barclays Plc*	5,50 %	09.08.2028	2.551.500	0,19
445.000	Barclays Plc*	6,13 %	29.12.2049	406.619	0,03
570.000	Barclays Plc*	8,00 %	29.12.2049	534.375	0,04
990.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,50 %	15.11.2026	926.440	0,07
465.000	BNP Paribas SA*	4,50 %	29.12.2049	357.396	0,03
535.000	BNP Paribas SA*	4,63 %	29.12.2049	414.679	0,03
914.000	BNP Paribas SA*	7,38 %	29.12.2049	904.378	0,07
570.000	BNP Paribas SA*	9,25 %	29.12.2049	595.677	0,05
1.300.000	BNP Paribas SA REG S*	4,63 %	29.12.2049	1.072.485	0,08
5.330.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	4.969.003	0,38
5.095.000	BP Capital Markets Plc*	4,88 %	29.12.2049	4.474.047	0,34
2.815.000	BPCE SA**	3,65 %	14.01.2037	2.110.558	0,16
3.925.000	Broadcom Inc**	3,14 %	15.11.2035	2.897.913	0,22
2.910.000	Broadcom Inc**	3,50 %	15.02.2041	2.076.740	0,16
785.000	Buckeye Partners LP**	4,13 %	01.03.2025	748.854	0,06
1.110.000	Buckeye Partners LP**	5,60 %	15.10.2044	819.203	0,06
240.000	Buckeye Partners LP**	5,85 %	15.11.2043	180.352	0,01
310.000	Builders FirstSource Inc**	4,25 %	01.02.2032	251.870	0,02
305.000	Builders FirstSource Inc**	6,38 %	15.06.2032	286.882	0,02
385.000	C&W Senior Financing DAC**	6,88 %	15.09.2027	358.889	0,03
1.300.000	Caesars Entertainment Inc**	4,63 %	15.10.2029	1.060.273	0,08
960.000	Caesars Entertainment Inc**	6,25 %	01.07.2025	934.757	0,07
1.625.000	Caesars Entertainment Inc**	8,13 %	01.07.2027	1.599.991	0,12
640.000	Callon Petroleum Co**	7,50 %	15.06.2030	586.432	0,04
595.000	Callon Petroleum Co**	8,00 %	01.08.2028	567.974	0,04
310.000	Calpine Corp**	3,75 %	01.03.2031	250.001	0,02
2.490.000	Calpine Corp**	4,50 %	15.02.2028	2.226.516	0,17
2.022.000	Calpine Corp**	4,63 %	01.02.2029	1.738.230	0,13
2.149.000	Calpine Corp**	5,00 %	01.02.2031	1.806.254	0,14
210.000	Calpine Corp**	5,13 %	15.03.2028	187.809	0,01
650.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	597.301	0,05
2.005.000	Capital One Financial Corp**	3,95 %	29.12.2049	1.579.701	0,12
295.000	Carnival Corp**	4,00 %	01.08.2028	241.121	0,02
1.010.000	Carnival Corp**	5,75 %	01.03.2027	722.928	0,05

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
825.000	Carnival Corp**	7,63 %	01.03.2026	655.351	0,05
1.905.000	Carnival Corp**	9,88 %	01.08.2027	1.803.378	0,14
685.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd**	10,38 %	01.05.2028	704.444	0,05
595.000	Carpenter Technology Corp*	7,63 %	15.03.2030	597.277	0,05
640.000	Cars.com Inc**	6,38 %	01.11.2028	569.272	0,04
320.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,13 %	15.02.2029	255.200	0,02
75.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,50 %	01.04.2030	59.315	0,00
1.415.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	01.02.2031	1.138.226	0,09
595.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	15.01.2034	440.300	0,03
1.720.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	15.08.2030	1.424.865	0,11
310.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.05.2032	247.357	0,02
320.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.06.2033	246.158	0,02
540.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.03.2030	466.938	0,04
1.725.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.02.2032	1.401.985	0,11
760.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	691.748	0,05
970.000	CD&R Smokey Buyer Inc**	6,75 %	15.07.2025	837.226	0,06
1.956.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	3,57 %	01.12.2031	1.615.482	0,12
325.000	Cedar Fair LP**	5,25 %	15.07.2029	292.388	0,02
1.060.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op*	5,38 %	15.04.2027	1.013.943	0,08
1.195.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	5,50 %	01.05.2025	1.184.050	0,09
200.000	Cemex SAB de CV**	7,38 %	05.06.2027	205.576	0,02
300.000	Centene Corp*	2,45 %	15.07.2028	253.791	0,02
315.000	Centene Corp*	2,50 %	01.03.2031	247.085	0,02
315.000	Centene Corp*	2,63 %	01.08.2031	248.133	0,02
300.000	Centene Corp*	3,00 %	15.10.2030	246.601	0,02
825.000	Centene Corp**	3,38 %	15.02.2030	699.291	0,05
2.324.000	Charles Schwab Corp**	4,00 %	29.12.2049	1.856.179	0,14
1.200.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	1.207.848	0,09
430.000	Chart Industries Inc**	9,50 %	01.01.2031	441.530	0,03
3.215.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	2.346.589	0,18
535.000	CHS/Community Health Systems Inc**	4,75 %	15.02.2031	389.424	0,03
455.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,25 %	15.05.2030	343.899	0,03
300.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63 %	15.03.2027	257.784	0,02
330.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00 %	15.01.2029	276.467	0,02
1.037.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00 %	15.12.2027	940.241	0,07
510.000	Churchill Downs Inc**	5,50 %	01.04.2027	484.044	0,04
5.385.000	Citigroup Inc**	3,29 %	17.03.2026	5.123.173	0,39
1.295.000	Citigroup Inc**	4,15 %	29.12.2049	1.060.513	0,08
360.000	Citigroup Inc**	4,70 %	29.12.2049	300.132	0,02

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
297.000	Citigroup Inc**	5,00 %	29.12.2049	265.076	0,02
294.000	Citizens Financial Group Inc**	6,00 %	29.12.2049	271.251	0,02
393.000	Citizens Financial Group Inc**	6,38 %	29.12.2049	359.900	0,03
346.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc**	5,13 %	15.08.2027	300.553	0,02
7.600.000	Comcast Corp**	2,94 %	01.11.2056	4.734.720	0,36
400.000	Commerzbank AG*	7,00 %	29.12.2049	380.213	0,03
845.000	CommonSpirit Health**	4,19 %	01.10.2049	661.246	0,05
230.000	CommonSpirit Health**	4,35 %	01.11.2042	195.035	0,01
905.000	CommScope Inc**	4,75 %	01.09.2029	731.308	0,06
1.710.000	CommScope Inc**	7,13 %	01.07.2028	1.225.204	0,09
2.305.000	CommScope Inc**	8,25 %	01.03.2027	1.790.017	0,14
1.320.000	CommScope Technologies LLC**	5,00 %	15.03.2027	898.632	0,07
205.000	CommScope Technologies LLC**	6,00 %	15.06.2025	186.972	0,01
2.539.000	Comstock Resources Inc**	6,75 %	01.03.2029	2.296.043	0,17
2.075.000	Condor Merger Sub Inc**	7,38 %	15.02.2030	1.672.068	0,13
390.000	Consolidated Communications Inc**	5,00 %	01.10.2028	288.119	0,02
725.000	Consolidated Communications Inc**	6,50 %	01.10.2028	565.182	0,04
2.875.000	Constellation Brands Inc*	2,25 %	01.08.2031	2.291.082	0,17
1.425.000	Corebridge Financial Inc**	4,35 %	05.04.2042	1.181.874	0,09
820.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13 %	15.01.2029	578.813	0,04
1.350.000	Corp. Nacional del Cobre de Chile*	3,15 %	14.01.2030	1.194.059	0,09
320.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	303.892	0,02
150.000	Coty Inc**	6,50 %	15.04.2026	144.232	0,01
565.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	4,80 %	06.08.2030	301.930	0,02
1.995.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	1.746.383	0,13
3.250.000	Credit Suisse Group AG**	3,09 %	14.05.2032	2.252.062	0,17
310.000	Credit Suisse Group AG*	4,50 %	29.12.2049	174.240	0,01
380.000	Credit Suisse Group AG*	5,10 %	29.12.2049	220.843	0,02
800.000	Credit Suisse Group AG*	5,25 %	29.12.2049	522.545	0,04
389.000	Credit Suisse Group AG*	6,38 %	29.12.2049	279.756	0,02
369.000	Credit Suisse Group AG*	7,50 %	29.12.2049	295.798	0,02
1.940.000	Credit Suisse Group AG**	9,02 %	15.11.2033	1.991.700	0,15
1.425.000	Credit Suisse Group AG*	9,75 %	29.12.2049	1.244.834	0,09
1.289.000	Crown Castle Towers LLC†	3,66 %	15.05.2025	1.249.238	0,09
195.000	CrownRock LP/CrownRock Finance Inc**	5,63 %	15.10.2025	188.572	0,01
895.000	CSC Holdings LLC**	4,63 %	01.12.2030	496.581	0,04
4.445.000	CSC Holdings LLC**	5,75 %	15.01.2030	2.516.737	0,19
280.000	CSC Holdings LLC**	6,50 %	01.02.2029	229.492	0,02
860.000	CSC Holdings LLC**	7,50 %	01.04.2028	586.692	0,04
1.290.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	1.233.784	0,09
4.720.000	CVS Health Corp*	5,05 %	25.03.2048	4.260.439	0,32

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.085.000	DaVita Inc**	3,75 %	15.02.2031	812.182	0,06
800.000	DaVita Inc**	4,63 %	01.06.2030	645.233	0,05
745.000	DCP Midstream Operating LP**	5,85 %	21.05.2043	728.573	0,06
1.720.000	Delta Air Lines Inc*	3,75 %	28.10.2029	1.432.750	0,11
1.340.000	Diamond BC BV**	4,63 %	01.10.2029	1.077.092	0,08
1.667.000	Discover Financial Services**	5,50 %	29.12.2049	1.333.214	0,10
3.090.000	Discovery Communications LLC**	4,65 %	15.05.2050	2.136.500	0,16
1.005.000	DISH DBS Corp**	5,13 %	01.06.2029	650.220	0,05
1.105.000	DISH DBS Corp**	7,38 %	01.07.2028	783.583	0,06
565.000	Dominion Energy Inc**	4,35 %	29.12.2049	477.387	0,04
1.555.000	DT Midstream Inc**	4,13 %	15.06.2029	1.338.909	0,10
500.000	Ecopetrol SA*	5,88 %	28.05.2045	349.217	0,03
3.870.000	Edison International**	5,00 %	29.12.2049	3.244.800	0,25
870.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	859.684	0,07
4.830.000	Enbridge Inc*	2,50 %	14.02.2025	4.560.689	0,34
415.000	Endurance International Group Holdings Inc**	6,00 %	15.02.2029	285.811	0,02
3.290.000	Enterprise Products Operating LLC*	4,20 %	31.01.2050	2.602.630	0,20
575.000	Envision Healthcare Corp**	8,75 %	15.10.2026	159.256	0,01
1.295.000	EPR Properties*	3,75 %	15.08.2029	1.016.289	0,08
355.000	EQM Midstream Partners LP**	4,50 %	15.01.2029	298.696	0,02
460.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75 %	15.01.2031	376.949	0,03
2.305.000	EQM Midstream Partners LP*	5,50 %	15.07.2028	2.065.172	0,16
265.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00 %	01.07.2025	256.180	0,02
370.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50 %	01.07.2027	354.275	0,03
245.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	240.243	0,02
275.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2030	265.348	0,02
1.390.000	EQT Corp*	5,70 %	01.04.2028	1.384.401	0,10
441.000	Fifth Third Bancorp**	5,10 %	29.12.2049	420.053	0,03
875.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	01.03.2026	829.943	0,06
1.185.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	15.10.2027	1.114.236	0,08
230.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	224.342	0,02
360.000	FirstEnergy Corp*	3,40 %	01.03.2050	238.167	0,02
557.000	FirstEnergy Corp*	5,35 %	15.07.2047	498.272	0,04
555.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	4,38 %	01.04.2031	462.653	0,04
815.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	5,88 %	15.04.2030	760.373	0,06
415.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	6,13 %	15.04.2032	387.629	0,03
325.000	Ford Motor Co*	3,25 %	12.02.2032	244.310	0,02
1.100.000	Ford Motor Co*	4,75 %	15.01.2043	792.053	0,06
2.225.000	Ford Motor Co*	5,29 %	08.12.2046	1.700.700	0,13
595.000	Ford Motor Co*	9,63 %	22.04.2030	674.138	0,05
305.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,90 %	16.02.2028	252.279	0,02

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
310.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,90 %	10.02.2029	248.011	0,02
475.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,38 %	13.11.2025	430.247	0,03
575.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,63 %	17.06.2031	452.443	0,03
880.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,00 %	13.11.2030	724.068	0,05
45.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,13 %	17.08.2027	40.378	0,00
80.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,39 %	08.01.2026	74.700	0,01
725.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,11 %	03.05.2029	658.155	0,05
450.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,13 %	16.06.2025	433.594	0,03
525.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,35 %	04.11.2027	539.280	0,04
530.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,00 %	01.05.2028	463.225	0,04
715.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	15.10.2027	665.501	0,05
1.200.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	01.11.2029	929.971	0,07
520.000	Frontier Communications Holdings LLC**	6,00 %	15.01.2030	409.174	0,03
785.000	Frontier Communications Holdings LLC**	6,75 %	01.05.2029	650.475	0,05
505.000	Frontier Communications Holdings LLC**	8,75 %	15.05.2030	514.441	0,04
175.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	176.008	0,01
540.000	Garda World Security Corp**	4,63 %	15.02.2027	477.738	0,04
870.000	Garda World Security Corp**	6,00 %	01.06.2029	708.048	0,05
1.240.000	Garda World Security Corp**	9,50 %	01.11.2027	1.196.106	0,09
3.090.000	General Motors Co*	5,15 %	01.04.2038	2.676.869	0,20
5.865.000	General Motors Financial Co Inc*	3,80 %	07.04.2025	5.666.482	0,43
1.480.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,25 %	15.05.2026	1.356.489	0,10
330.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,50 %	01.10.2025	315.906	0,02
760.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	7,75 %	01.02.2028	700.766	0,05
630.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	595.867	0,05
845.000	Georgetown University**	2,94 %	01.04.2050	537.778	0,04
4.218.839	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50 %	15.09.2024	3.595.084	0,27
330.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	5,63 %	01.06.2029	259.287	0,02
9.310.000	Goldman Sachs Group Inc**	1,76 %	24.01.2025	8.914.899	0,67
565.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,65 %	29.12.2049	457.650	0,03
280.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,80 %	29.12.2049	228.466	0,02
1.105.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,13 %	29.12.2049	921.187	0,07
860.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	31.05.2026	812.633	0,06
1.665.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	15.07.2029	1.391.024	0,11
470.000	Graham Packaging Co Inc**	7,13 %	15.08.2028	392.907	0,03
590.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	478.980	0,04
925.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00 %	15.05.2027	887.501	0,07
830.000	Hanesbrands Inc**	4,88 %	15.05.2026	743.116	0,06
1.935.000	Harvest Midstream I LP**	7,50 %	01.09.2028	1.851.543	0,14
800.000	HB Fuller Co*	4,25 %	15.10.2028	710.732	0,05
245.000	HCA Inc*	5,63 %	01.09.2028	244.099	0,02

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
240.000	HCA Inc*	5,88 %	01.02.2029	239.755	0,02
770.000	Hess Corp*	5,60 %	15.02.2041	731.232	0,06
376.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	5,75 %	01.02.2029	335.208	0,03
415.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00 %	01.02.2031	359.518	0,03
340.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25 %	01.11.2028	308.304	0,02
630.000	HSBC Holdings Plc*	4,00 %	29.12.2049	546.496	0,04
560.000	HSBC Holdings Plc*	4,70 %	29.12.2049	445.140	0,03
5.040.000	HSBC Holdings Plc**	6,00 %	29.12.2049	4.638.361	0,35
781.000	HSBC Holdings Plc**	6,38 %	29.12.2049	757.923	0,06
465.000	HUB International Ltd**	7,00 %	01.05.2026	456.174	0,03
2.075.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	1.887.336	0,14
700.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13 %	01.04.2029	635.029	0,05
721.000	Huntington Bancshares Inc**	5,63 %	29.12.2049	672.925	0,05
508.000	Huntington Bancshares Inc**	5,70 %	29.12.2049	472.608	0,04
515.000	IAA Inc**	5,50 %	15.06.2027	503.193	0,04
260.000	Iliad Holding SASU**	6,50 %	15.10.2026	241.588	0,02
200.000	Iliad Holding SASU**	7,00 %	15.10.2028	181.024	0,01
775.000	Imola Merger Corp**	4,75 %	15.05.2029	673.962	0,05
2.335.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc*	3,38 %	15.01.2026	2.148.188	0,16
2.018.000	ING Groep NV*	3,88 %	29.12.2049	1.480.444	0,11
1.202.000	ING Groep NV*	5,75 %	29.12.2049	1.067.640	0,08
589.000	ING Groep NV*	6,50 %	29.12.2049	558.247	0,04
275.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00 %	15.09.2028	222.329	0,02
2.000.000	Intesa Sanpaolo SpA**	8,25 %	21.11.2033	2.034.670	0,15
305.000	Iron Mountain Inc**	4,50 %	15.02.2031	251.379	0,02
830.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2027	764.621	0,06
1.360.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2029	1.188.477	0,09
1.880.000	Iron Mountain Inc**	5,00 %	15.07.2028	1.691.907	0,13
2.195.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.03.2028	2.022.890	0,15
390.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.07.2030	339.789	0,03
2.150.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	1.867.041	0,14
295.000	Iron Mountain Information Management Services Inc**	5,00 %	15.07.2032	245.483	0,02
980.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	827.135	0,06
940.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc**	7,75 %	15.10.2025	866.285	0,07
2.230.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	1.681.978	0,13
30.000	JELD-WEN Inc**	6,25 %	15.05.2025	28.269	0,00
7.015.000	JPMorgan Chase & Co**	1,56 %	10.12.2025	6.499.722	0,49
1.841.000	JPMorgan Chase & Co**	4,60 %	29.12.2049	1.626.984	0,12
2.610.000	JPMorgan Chase & Co**	4,85 %	25.07.2028	2.548.470	0,19
449.000	JPMorgan Chase & Co**	5,00 %	29.12.2049	411.085	0,03
263.000	JPMorgan Chase & Co**	7,02 %	29.12.2049	259.805	0,02

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
500.000	KAR Auction Services Inc**	5,13 %	01.06.2025	489.245	0,04
580.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75 %	19.04.2047	452.226	0,03
255.000	KB Home*	4,00 %	15.06.2031	205.307	0,02
265.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	257.829	0,02
3.525.000	Kinder Morgan Inc*	5,55 %	01.06.2045	3.230.632	0,24
550.000	Kinetik Holdings LP**	5,88 %	15.06.2030	516.523	0,04
185.000	Kraft Heinz Foods Co**	3,88 %	15.05.2027	177.040	0,01
600.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2027	609.351	0,05
600.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	611.682	0,05
645.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	551.906	0,04
915.000	Level 3 Financing Inc**	3,63 %	15.01.2029	671.519	0,05
265.000	Level 3 Financing Inc**	3,75 %	15.07.2029	190.986	0,01
1.195.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	996.929	0,08
955.000	Liberty Mutual Group Inc**	4,13 %	15.12.2051	779.242	0,06
1.300.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2029	755.426	0,06
510.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88 %	01.11.2024	494.595	0,04
980.000	Live Nation Entertainment Inc**	5,63 %	15.03.2026	928.294	0,07
1.290.000	Live Nation Entertainment Inc**	6,50 %	15.05.2027	1.264.948	0,10
310.000	Lloyds Banking Group Plc**	7,50 %	29.12.2049	299.834	0,02
964.000	Lloyds Banking Group Plc Series WI*	7,50 %	29.12.2049	936.526	0,07
1.870.000	Lockheed Martin Corp*	5,70 %	15.11.2054	1.971.565	0,15
1.935.000	Lowe's Cos Inc*	4,45 %	01.04.2062	1.514.325	0,11
1.520.000	M&T Bank Corp**	3,50 %	29.12.2049	1.181.815	0,09
200.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	153.926	0,01
1.370.000	Masonite International Corp**	3,50 %	15.02.2030	1.110.010	0,08
495.000	Masonite International Corp**	5,38 %	01.02.2028	458.533	0,03
160.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,25 %	15.04.2025	148.284	0,01
520.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	437.754	0,03
640.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	530.091	0,04
200.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38 %	30.01.2027	181.118	0,01
525.000	Medco Bell Pte Ltd 144A*	6,38 %	30.01.2027	475.436	0,04
2.420.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	1.954.743	0,15
915.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	786.205	0,06
2.315.000	Merck & Co Inc*	2,90 %	10.12.2061	1.482.991	0,11
215.000	Metinvest BV*	7,65 %	01.10.2027	122.550	0,01
900.000	Metinvest BV*	7,75 %	17.10.2029	456.750	0,03
445.000	MHP SE*	7,75 %	10.05.2024	226.736	0,02
585.000	Molina Healthcare Inc**	3,88 %	15.11.2030	496.621	0,04
1.300.000	Molina Healthcare Inc**	3,88 %	15.05.2032	1.081.450	0,08
3.290.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	2.565.415	0,19
8.235.000	Morgan Stanley**	2,48 %	16.09.2036	5.990.056	0,45

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
875.000	Mount Sinai Hospitals Group Inc**	3,74 %	01.07.2049	649.437	0,05
5.455.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75 %	01.11.2028	3.639.643	0,28
1.160.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	3,50 %	15.03.2031	797.585	0,06
1.755.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	4,63 %	01.08.2029	1.341.495	0,10
660.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,25 %	01.08.2026	602.187	0,05
315.000	MSCI Inc**	3,25 %	15.08.2033	243.717	0,02
295.000	MSCI Inc**	3,63 %	01.09.2030	245.742	0,02
300.000	MSCI Inc**	3,63 %	01.11.2031	248.528	0,02
282.645	MV24 Capital BV*	6,75 %	01.06.2034	258.772	0,02
775.000	Nabors Industries Ltd**	7,25 %	15.01.2026	731.584	0,06
390.000	Natura Cosmeticos SA**	4,13 %	03.05.2028	318.714	0,02
5.290.000	NatWest Group Plc*	3,03 %	28.11.2035	3.905.718	0,30
1.310.000	NatWest Group Plc*	4,60 %	29.12.2049	941.141	0,07
830.000	NatWest Group Plc*	6,00 %	29.12.2049	768.536	0,06
910.000	NCL Corp Ltd**	3,63 %	15.12.2024	778.904	0,06
205.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.03.2026	161.376	0,01
480.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.02.2027	416.378	0,03
160.000	Netflix Inc**	5,88 %	15.11.2028	162.565	0,01
160.000	Netflix Inc**	6,38 %	15.05.2029	164.955	0,01
2.040.000	New Fortress Energy Inc**	6,50 %	30.09.2026	1.898.424	0,14
1.200.000	New Fortress Energy Inc**	6,75 %	15.09.2025	1.137.744	0,09
1.400.000	Nordea Bank Abp*	3,75 %	29.12.2049	1.084.374	0,08
1.250.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,13 %	01.03.2028	1.201.805	0,09
1.040.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	4,75 %	30.04.2027	916.357	0,07
985.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	6,00 %	15.02.2028	763.900	0,06
1.435.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88 %	01.06.2024	1.391.650	0,11
1.862.000	NOVA Chemicals Corp**	5,25 %	01.06.2027	1.676.811	0,13
1.905.000	Novelis Corp**	3,88 %	15.08.2031	1.557.799	0,12
555.000	NRG Energy Inc**	3,38 %	15.02.2029	448.418	0,03
3.455.000	NRG Energy Inc**	3,63 %	15.02.2031	2.632.788	0,20
315.000	NRG Energy Inc**	3,88 %	15.02.2032	237.187	0,02
250.000	NRG Energy Inc**	5,25 %	15.06.2029	221.105	0,02
1.225.000	NRG Energy Inc*	5,75 %	15.01.2028	1.151.868	0,09
945.000	NuStar Logistics LP*	5,75 %	01.10.2025	910.085	0,07
710.000	Occidental Petroleum Corp*	5,50 %	01.12.2025	708.580	0,05
285.000	Occidental Petroleum Corp**	5,55 %	15.03.2026	284.396	0,02
920.000	Occidental Petroleum Corp*	5,88 %	01.09.2025	918.168	0,07
365.000	Occidental Petroleum Corp*	6,13 %	01.01.2031	369.057	0,03
730.000	Occidental Petroleum Corp**	6,60 %	15.03.2046	752.809	0,06
645.000	Occidental Petroleum Corp*	8,88 %	15.07.2030	729.292	0,06
965.000	Olympus Water US Holding Corp**	4,25 %	01.10.2028	784.693	0,06



## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
395.000	Olympus Water US Holding Corp**	6,25 %	01.10.2029	300.400	0,02
1.320.000	OneMain Finance Corp*	3,50 %	15.01.2027	1.094.570	0,08
2.030.000	OneMain Finance Corp*	3,88 %	15.09.2028	1.616.936	0,12
590.000	OneMain Finance Corp*	4,00 %	15.09.2030	440.992	0,03
2.390.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	2.301.343	0,17
2.415.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	2.301.761	0,17
600.000	Open Text Holdings Inc**	4,13 %	01.12.2031	467.244	0,04
2.225.000	Oracle Corp*	3,95 %	25.03.2051	1.594.926	0,12
3.830.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.11.2047	2.815.647	0,21
159.000	Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**	5,00 %	15.08.2027	143.386	0,01
1.075.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	1.081.947	0,08
50.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**	4,00 %	15.10.2027	44.433	0,00
1.175.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc**	4,38 %	15.10.2028	1.051.243	0,08
3.175.000	Paramount Global**	4,20 %	19.05.2032	2.606.679	0,20
1.515.000	Paramount Global**	4,95 %	15.01.2031	1.350.019	0,10
3.580.000	Paramount Global**	6,38 %	30.03.2062	2.931.946	0,22
550.000	PDC Energy Inc**	5,75 %	15.05.2026	525.910	0,04
530.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp**	8,00 %	15.11.2029	345.025	0,03
870.000	Performance Food Group Inc**	5,50 %	15.10.2027	822.402	0,06
460.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	431.133	0,03
420.000	Pertamina Persero PT*	6,45 %	30.05.2044	420.645	0,03
195.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50 %	10.06.2051	149.773	0,01
762.400	Petroleos de Venezuela SA*	5,38 %	12.04.2027	37.167	0,00
4.488.565	Petroleos de Venezuela SA*	6,00 %	16.05.2024	230.039	0,02
2.302.978	Petroleos de Venezuela SA**	6,00 %	15.11.2026	112.270	0,01
810.000	Petroleos Mexicanos*	6,35 %	12.02.2048	497.036	0,04
1.935.000	Petroleos Mexicanos*	7,69 %	23.01.2050	1.343.245	0,10
2.715.000	Pilgrim's Pride Corp**	3,50 %	01.03.2032	2.128.411	0,16
1.000.000	Pilgrim's Pride Corp**	4,25 %	15.04.2031	852.000	0,06
2.028.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	3,55 %	15.12.2029	1.762.802	0,13
2.178.000	PNC Financial Services Group Inc**	3,40 %	29.12.2049	1.731.510	0,13
490.000	Post Holdings Inc**	5,63 %	15.01.2028	461.974	0,04
705.000	Presidio Holdings Inc**	4,88 %	01.02.2027	644.003	0,05
1.180.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	1.095.819	0,08
960.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,25 %	15.04.2024	944.669	0,07
1.605.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	1.548.344	0,12
2.010.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	1.833.562	0,14
655.000	Prudential Financial Inc**	5,13 %	01.03.2052	596.941	0,05
1.345.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	4,50 %	15.09.2026	990.297	0,07
460.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	6,50 %	15.09.2028	193.494	0,01
3.625.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	2.649.186	0,20

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.216.000	Realty Group LLC/Realty Co-Issuer Corp**	5,75 %	15.01.2029	1.679.041	0,13
2.100.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75 %	15.10.2027	1.903.779	0,14
1.460.000	RLJ Lodging Trust LP**	3,75 %	01.07.2026	1.302.077	0,10
2.280.000	Roche Holdings Inc**	2,61 %	13.12.2051	1.487.446	0,11
300.000	Rockcliff Energy II LLC**	5,50 %	15.10.2029	274.868	0,02
1.725.000	Rogers Communications Inc**	3,80 %	15.03.2032	1.493.270	0,11
3.640.000	Rogers Communications Inc**	4,55 %	15.03.2052	2.838.902	0,21
3.495.000	Royal Bank of Canada**	3,38 %	14.04.2025	3.380.346	0,26
1.300.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	31.08.2026	1.095.250	0,08
1.960.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	1.567.647	0,12
3.970.000	SBA Tower Trust**	2,59 %	15.10.2031	3.059.657	0,23
1.355.000	SBA Tower Trust**	2,84 %	15.01.2025	1.278.019	0,10
670.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc**	5,25 %	15.08.2029	584.239	0,04
435.000	Select Medical Corp**	6,25 %	15.08.2026	414.507	0,03
245.000	Sensata Technologies BV**	4,00 %	15.04.2029	211.643	0,02
705.000	Sensata Technologies BV**	5,88 %	01.09.2030	669.165	0,05
870.000	Service Properties Trust**	3,95 %	15.01.2028	619.067	0,05
1.290.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	15.02.2028	1.128.347	0,09
1.030.000	Sirius XM Radio Inc**	3,13 %	01.09.2026	915.861	0,07
565.000	Sirius XM Radio Inc**	3,88 %	01.09.2031	441.883	0,03
1.780.000	Sirius XM Radio Inc**	4,13 %	01.07.2030	1.472.888	0,11
175.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00 %	01.08.2027	162.148	0,01
2.025.000	Sirius XM Radio Inc**	5,50 %	01.07.2029	1.852.946	0,14
385.000	Six Flags Entertainment Corp**	4,88 %	31.07.2024	371.284	0,03
535.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	482.677	0,04
1.600.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB*	5,13 %	29.12.2049	1.496.000	0,12
460.000	Societe Generale SA*	4,75 %	29.12.2049	391.620	0,03
960.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	956.016	0,07
5.425.000	Southern Co**	4,00 %	15.01.2051	4.950.313	0,37
1.685.000	Southwestern Energy Co*	4,75 %	01.02.2032	1.443.228	0,11
555.000	Southwestern Energy Co*	5,38 %	15.03.2030	507.239	0,04
215.000	Sprint Capital Corp**	8,75 %	15.03.2032	256.356	0,02
80.000	Sprint LLC**	7,63 %	15.02.2025	82.763	0,01
970.000	SPX FLOW Inc**	8,75 %	01.04.2030	766.261	0,06
1.640.000	Standard Chartered Plc*	4,30 %	29.12.2049	1.262.710	0,10
330.000	Standard Industries Inc**	3,38 %	15.01.2031	249.014	0,02
1.550.000	Standard Industries Inc**	4,38 %	15.07.2030	1.266.365	0,10
295.000	Standard Industries Inc**	4,75 %	15.01.2028	265.898	0,02
455.000	Starwood Property Trust Inc**	3,75 %	31.12.2024	427.778	0,03
1.655.000	Starwood Property Trust Inc**	4,75 %	15.03.2025	1.582.130	0,12
970.000	Starwood Property Trust Inc**	5,50 %	01.11.2023	963.025	0,07

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
730.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50 %	31.10.2026	593.264	0,04
240.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp*	5,75 %	15.04.2025	204.174	0,02
1.985.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	8,50 %	15.10.2026	1.893.372	0,14
1.770.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	1.583.513	0,12
2.245.000	SVB Financial Group**	4,25 %	29.12.2049	1.477.039	0,11
1.555.000	Sysco Corp*	3,15 %	14.12.2051	1.029.120	0,08
1.998.000	Sysco Corp*	6,60 %	01.04.2050	2.189.549	0,17
1.495.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50 %	15.01.2028	1.328.188	0,10
935.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.03.2027	874.410	0,07
1.825.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	1.580.505	0,12
830.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.09.2031	714.699	0,05
1.685.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50 %	01.10.2025	1.702.819	0,13
80.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp**	5,00 %	15.01.2028	76.447	0,01
70.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp**	6,50 %	15.07.2027	70.558	0,01
70.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp**	6,88 %	15.01.2029	70.681	0,01
490.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,75 %	15.01.2028	459.656	0,03
260.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,88 %	15.06.2027	250.079	0,02
615.000	Team Health Holdings Inc**	6,38 %	01.02.2025	355.359	0,03
2.555.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	2.292.934	0,17
1.610.000	Terex Corp**	5,00 %	15.05.2029	1.449.040	0,11
1.035.000	T-Mobile USA Inc**	2,25 %	15.02.2026	943.414	0,07
530.000	T-Mobile USA Inc**	3,38 %	15.04.2029	467.828	0,04
4.110.000	T-Mobile USA Inc*	3,40 %	15.10.2052	2.780.144	0,21
2.135.000	T-Mobile USA Inc*	4,50 %	15.04.2050	1.765.828	0,13
345.000	Toll Brothers Finance Corp*	4,35 %	15.02.2028	314.048	0,02
1.415.000	TransDigm Inc*	5,50 %	15.11.2027	1.331.628	0,10
735.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	726.467	0,06
760.000	TransDigm Inc*	6,38 %	15.06.2026	740.555	0,06
1.845.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	1.828.371	0,14
970.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	891.513	0,07
840.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	772.048	0,06
2.170.000	Tronox Inc**	4,63 %	15.03.2029	1.807.881	0,14
1.725.000	Truist Financial Corp**	5,10 %	29.12.2049	1.604.250	0,12
289.000	Truist Financial Corp*	7,87 %	29.12.2049	286.688	0,02
200.000	UBS Group AG*	4,38 %	29.12.2049	152.452	0,01
2.500.000	UBS Group AG*	4,70 %	05.08.2027	2.419.497	0,18
650.000	UBS Group AG*	4,88 %	29.12.2049	552.500	0,04
1.516.000	UBS Group AG*	6,88 %	29.12.2049	1.484.831	0,11
481.000	UniCredit SpA**	8,00 %	29.12.2049	461.760	0,04
1.047.258	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88 %	15.10.2027	1.033.988	0,08
1.615.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	1.499.731	0,11

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
790.000	United Rentals North America Inc*	3,75 %	15.01.2032	645.533	0,05
590.000	United Rentals North America Inc*	3,88 %	15.02.2031	495.922	0,04
500.000	United Rentals North America Inc*	5,25 %	15.01.2030	470.678	0,04
1.380.000	United Rentals North America Inc**	6,00 %	15.12.2029	1.374.032	0,10
625.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	6,00 %	15.01.2030	396.300	0,03
3.355.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50 %	15.02.2029	2.228.961	0,17
2.780.000	US Bancorp**	3,70 %	29.12.2049	2.279.600	0,17
3.925.000	Verizon Communications Inc**	2,36 %	15.03.2032	3.121.739	0,24
2.445.000	Verizon Communications Inc*	2,99 %	30.10.2056	1.502.520	0,11
2.795.000	Viatrix Inc**	4,00 %	22.06.2050	1.731.757	0,13
455.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,25 %	01.12.2026	425.481	0,03
415.000	Virgin Media Finance Plc**	5,00 %	15.07.2030	333.533	0,03
1.250.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	5,50 %	15.05.2029	1.122.581	0,08
2.000.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC*	5,00 %	15.07.2028	1.751.285	0,13
1.285.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	1.032.016	0,08
1.310.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	1.183.480	0,09
1.330.000	Vistra Corp**	7,00 %	29.12.2049	1.212.133	0,09
1.595.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38 %	01.05.2029	1.377.493	0,10
2.725.000	Vistra Operations Co LLC**	5,00 %	31.07.2027	2.535.050	0,19
445.000	Vistra Operations Co LLC**	5,50 %	01.09.2026	429.446	0,03
193.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38 %	11.02.2026	166.520	0,01
3.630.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,14 %	15.03.2052	2.652.903	0,20
990.000	Warnermedia Holdings Inc 144A**	5,14 %	15.03.2052	723.519	0,05
720.000	Western Midstream Operating LP*	4,30 %	01.02.2030	630.126	0,05
2.750.000	Westpac Banking Corp**	3,02 %	18.11.2036	2.050.853	0,16
655.000	White Capital Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	567.060	0,04
2.440.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	1.975.839	0,15
895.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc**	4,38 %	15.08.2028	804.426	0,06
2.095.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,25 %	15.05.2027	1.893.987	0,14
4.276.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,50 %	01.03.2025	4.068.212	0,31
660.000	Wynn Macau Ltd*	5,50 %	15.01.2026	606.487	0,05
1.565.000	XHR LP**	6,38 %	15.08.2025	1.507.162	0,11
705.000	Zayo Group Holdings Inc**	6,13 %	01.03.2028	401.306	0,03
470.000	Ziff Davis Inc**	4,63 %	15.10.2030	398.539	0,03
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>601.915.888</b>	<b>45,50</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>637.567.177</b>	<b>48,20</b>
<b>Staatsanleihen 18,40 % (31. Dezember 2021: 19,64 %)</b>					
<b>Kolumbianischer Peso</b>					
2.132.400.000	Colombian TES*	6,00 %	28.04.2028	329.126	0,03
4.141.500.000	Colombian TES*	7,00 %	30.06.2032	582.759	0,04

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Unternehmensanleihen 48,20 % (31. Dezember 2021: 39,66 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
3.618.000.000	Colombian TES*	7,25 %	18.10.2034	493.197	0,04
<b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>				<b>1.405.082</b>	<b>0,11</b>
<b>Ungarischer Forint</b>					
273.520.000	Hungary Government Bond*	3,00 %	27.10.2027	529.739	0,04
698.550.000	Hungary Government Bond*	3,25 %	22.10.2031	1.223.372	0,09
<b>Ungarischer Forint insgesamt</b>				<b>1.753.111</b>	<b>0,13</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>					
11.985.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,13 %	15.05.2028	754.013	0,06
12.889.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.09.2030	837.481	0,06
28.842.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2029	1.996.861	0,15
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>				<b>3.588.355</b>	<b>0,27</b>
<b>Mexikanischer Peso</b>					
27.490.000	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	1.306.474	0,10
28.331.200	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	1.415.030	0,11
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>				<b>2.721.504</b>	<b>0,21</b>
<b>Peruanischer Sol</b>					
13.670.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	3.150.909	0,24
5.351.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	1.256.444	0,09
<b>Peruanischer Sol insgesamt</b>				<b>4.407.353</b>	<b>0,33</b>
<b>Südafrikanischer Rand</b>					
15.963.990	Republic of South Africa Government Bond*	8,00 %	31.01.2030	837.826	0,06
9.356.291	Republic of South Africa Government Bond*	8,25 %	31.03.2032	469.350	0,04
11.071.499	Republic of South Africa Government Bond*	8,50 %	31.01.2037	517.457	0,04
<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>				<b>1.824.633</b>	<b>0,14</b>
<b>Türkische Lira</b>					
5.543.099	Turkey Government Bond*	1,50 %	18.06.2025	412.930	0,03
20.195.926	Turkey Government Bond*	11,70 %	13.11.2030	1.292.488	0,10
<b>Türkische Lira insgesamt</b>				<b>1.705.418</b>	<b>0,13</b>
<b>US-Dollar</b>					
585.000	Angolan Government International Bond*	8,00 %	26.11.2029	514.964	0,04
1.805.000	Angolan Government International Bond*	9,38 %	08.05.2048	1.435.787	0,11
485.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	372.402	0,03
460.000	Colombia Government International Bond*	5,00 %	15.06.2045	314.666	0,02
1.925.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	1.678.558	0,13

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 18,40 % (31. Dezember 2021: 19,64 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
645.000	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2035	300.027	0,02
420.000	Ecuador Government International Bond*	5,50 %	31.07.2030	271.979	0,02
345.000	Egypt Government International Bond*	5,88 %	16.02.2031	241.120	0,02
1.310.000	Egypt Government International Bond*	8,50 %	31.01.2047	877.236	0,07
200.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	89.468	0,01
1.815.000	Indonesia Government International Bond*	4,63 %	15.04.2043	1.659.405	0,13
1.700.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,13 %	15.06.2033	1.519.294	0,11
1.895.000	Mexico Government International Bond*	3,50 %	12.02.2034	1.521.247	0,11
1.890.000	Mexico Government International Bond*	4,40 %	12.02.2052	1.396.553	0,11
485.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	419.560	0,03
830.000	Oman Government International Bond*	6,25 %	25.01.2031	837.701	0,06
1.195.000	Oman Government International Bond*	7,00 %	25.01.2051	1.159.410	0,09
825.000	Panama Government International Bond*	2,25 %	29.09.2032	614.011	0,05
1.100.000	Panama Government International Bond*	3,30 %	19.01.2033	893.300	0,07
815.000	Paraguay Government International Bond*	4,95 %	28.04.2031	790.655	0,06
905.000	Peruvian Government International Bond*	3,00 %	15.01.2034	715.768	0,05
635.000	Qatar Government International Bond*	4,40 %	16.04.2050	582.772	0,04
785.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,65 %	27.09.2047	579.698	0,04
485.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75 %	30.09.2049	358.334	0,03
1.422.000	Romanian Government International Bond*	3,00 %	14.02.2031	1.127.588	0,08
580.000	Romanian Government International Bond*	3,63 %	27.03.2032	464.298	0,03
1.184.000	Romanian Government International Bond*	4,00 %	14.02.2051	789.234	0,06
630.000	Romanian Government International Bond 144A*	4,00 %	14.02.2051	420.692	0,03
725.000	Saudi Government International Bond <sup>†</sup>	3,25 %	17.11.2051	525.322	0,04
580.000	Saudi Government International Bond*	3,75 %	21.01.2055	458.583	0,03
1.800.000	Ukraine Government International Bond*	7,25 %	15.03.2035	340.637	0,03
6.048.551	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,13 %	15.02.2052	3.923.302	0,30
71.000.000	United States Treasury Note/Bond*	0,13 %	31.03.2023	70.273.703	5,31
9.290.000	United States Treasury Note/Bond*	0,25 %	15.04.2023	9.181.986	0,69
19.265.000	United States Treasury Note/Bond*	0,38 %	31.10.2023	18.578.678	1,40
19.825.000	United States Treasury Note/Bond*	0,88 %	30.06.2026	17.731.759	1,34
18.530.000	United States Treasury Note/Bond*	1,25 %	31.03.2028	16.109.519	1,22
20.000.000	United States Treasury Note/Bond*	1,25 %	15.08.2031	16.223.438	1,23
28.860.000	United States Treasury Note/Bond*	1,63 %	15.05.2031	24.279.602	1,84
7.225.000	United States Treasury Note/Bond*	1,88 %	15.02.2051	4.594.507	0,35
4.025.000	United States Treasury Note/Bond*	2,25 %	15.02.2052	2.800.520	0,21
3.990.000	United States Treasury Note/Bond*	2,38 %	15.11.2049	2.886.282	0,22
4.070.000	United States Treasury Note/Bond*	2,88 %	15.05.2052	3.262.359	0,25
1.915.000	United States Treasury Note/Bond*	3,13 %	15.08.2044	1.619.970	0,12
1.145.000	United States Treasury Note/Bond*	3,13 %	15.05.2048	962.873	0,07
2.085.000	United States Treasury Note/Bond*	3,25 %	15.05.2042	1.828.936	0,14

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihen 18,40 % (31. Dezember 2021: 19,64 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
4.430.000	United States Treasury Note/Bond*	4,25 %	15.11.2040	4.529.588	0,34
2.605.000	United States Treasury Note/Bond*	4,38 %	15.02.2038	2.729.552	0,21
905.000	Uruguay Government International Bond*	5,10 %	18.06.2050	890.640	0,07
3.136.300	Venezuela Government International Bond*	8,25 %	13.10.2024	274.426	0,02
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>225.951.909</b>	<b>17,08</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>243.357.365</b>	<b>18,40</b>
<b>Mortgage-Backed Securities 26,22 % (31. Dezember 2021: 18,09 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
2.083.166	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.08.2051	1.770.748	0,13
3.622.480	Fannie Mae Pool (FS1632)	2,50 %	01.08.2051	3.080.809	0,23
4.284.090	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.11.2051	3.636.209	0,28
4.333.256	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.02.2052	3.673.204	0,28
2.617.434	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.03.2052	2.231.491	0,17
3.479.359	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.04.2052	2.956.892	0,22
2.468.824	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.05.2052	2.096.765	0,16
2.220.649	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.06.2050	1.963.002	0,15
1.534.477	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.05.2051	1.348.173	0,10
2.315.924	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.08.2051	2.040.606	0,15
2.558.805	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.11.2051	2.258.367	0,17
2.566.269	Fannie Mae Pool (FS1172)	3,00 %	01.11.2051	2.257.375	0,17
4.021.473	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.03.2052	3.537.223	0,27
1.816.235	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.05.2052	1.595.867	0,12
1.363.293	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.06.2052	1.197.853	0,09
1.228.004	Fannie Mae Pool (CB0548)	3,50 %	01.05.2051	1.122.142	0,09
1.479.860	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2052	1.348.981	0,10
2.832.916	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2052	2.577.200	0,20
2.630.558	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.06.2052	2.394.721	0,18
2.978.360	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.06.2052	2.709.484	0,21
36.510.000	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.01.2053	33.173.542	2,51
1.385.645	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.05.2052	1.301.948	0,10
1.555.374	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2052	1.460.619	0,11
3.398.187	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2052	3.191.868	0,24
37.985.000	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.01.2053	35.628.883	2,69
1.146.376	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.06.2052	1.104.616	0,08
1.484.484	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.07.2052	1.430.186	0,11
1.206.596	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.07.2052	1.162.641	0,09
34.370.000	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.01.2053	33.083.489	2,50
1.833.674	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	1.810.034	0,14
2.082.012	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	2.055.171	0,16
44.510.000	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2053	43.866.114	3,32

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Mortgage-Backed Securities 26,22 % (31. Dezember 2021: 18,09 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
32.285.000	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.01.2053	32.374.723	2,45
1.205.000	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.01.2053	1.223.158	0,09
1.897.463	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.05.2051	1.611.436	0,12
4.251.087	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.04.2052	3.612.401	0,27
2.715.547	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.12.2051	2.387.825	0,18
515.000	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.03.2052	452.934	0,03
2.426.969	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.04.2052	2.137.649	0,16
2.920.120	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.05.2052	2.565.737	0,19
1.935.167	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.05.2052	1.701.268	0,13
579.236	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.06.2052	509.196	0,04
2.274.401	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.05.2052	2.069.318	0,16
1.298.207	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.05.2052	1.181.954	0,09
1.375.850	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.07.2052	1.251.677	0,09
2.510.765	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.09.2052	2.284.100	0,17
2.173.833	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.04.2052	2.044.545	0,15
1.543.907	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.06.2052	1.450.330	0,11
1.664.594	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.07.2052	1.563.375	0,12
1.601.814	Freddie Mac Pool (SD1060)	4,00 %	01.07.2052	1.505.057	0,11
3.479.293	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.08.2052	3.268.047	0,25
1.170.344	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.12.2052	1.098.924	0,08
1.282.792	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.07.2052	1.235.962	0,09
1.182.266	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.07.2052	1.139.198	0,09
2.340.211	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.08.2052	2.255.350	0,17
2.668.261	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.08.2052	2.570.850	0,19
1.298.345	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.11.2052	1.281.607	0,10
2.647.621	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.11.2052	2.613.488	0,20
2.739.273	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.11.2052	2.750.626	0,21
12.275.000	Ginnie Mae	4,00 %	01.01.2053	11.617.182	0,88
18.705.000	Ginnie Mae	4,50 %	01.01.2053	18.148.059	1,37
23.085.000	Ginnie Mae	5,00 %	01.01.2053	22.878.198	1,73
8.990.000	Ginnie Mae	5,50 %	01.01.2053	9.043.078	0,68
<b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>				<b>346.893.475</b>	<b>26,22</b>
<b>Kommunalanleihen 1,57 % (31. Dezember 2021: 1,18 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
565.000	Bay Area Toll Authority	7,04 %	01.04.2050	696.329	0,05
845.000	California State University	2,98 %	01.11.2051	586.607	0,04
875.000	Central Texas Turnpike System	3,03 %	15.08.2041	621.416	0,05
265.000	City of Atlantic City NJ	4,29 %	01.09.2026	253.331	0,02
1.080.000	City of New York NY	5,00 %	01.08.2032	1.275.225	0,10
650.000	City of New York NY	5,00 %	01.05.2035	737.228	0,06



## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Kommunalanleihen 1,57 % (31. Dezember 2021: 1,18 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
845.000	Commonwealth Financing Authority	3,53 %	01.06.2042	662.710	0,05
845.000	County of Clark NV	3,23 %	01.07.2044	588.610	0,05
705.000	Dallas Area Rapid Transit	2,82 %	01.12.2042	498.291	0,04
795.000	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency	3,92 %	15.01.2053	573.293	0,04
1.035.000	Gilbert Water Resource Municipal Property Corp	5,00 %	15.07.2031	1.217.819	0,09
845.000	Grand Parkway Transportation Corp	3,24 %	01.10.2052	601.104	0,05
845.000	Highland Local School District/Medina County	3,19 %	01.12.2049	563.582	0,04
845.000	JobsOhio Beverage System	2,83 %	01.01.2038	661.611	0,05
460.000	Los Angeles Community College District	6,75 %	01.08.2049	573.337	0,04
830.000	Massachusetts Bay Transportation Authority Sales Tax Revenue	5,25 %	01.07.2032	1.007.878	0,08
1.900.000	Massachusetts Development Finance Agency	5,00 %	15.11.2032	2.286.670	0,17
400.000	Massachusetts Educational Financing Authority	4,08 %	01.07.2027	380.183	0,03
725.000	Michigan Finance Authority	3,38 %	01.12.2040	582.298	0,04
200.000	New Jersey Housing & Mortgage Finance Agency	3,80 %	01.10.2032	191.647	0,01
935.000	New York City Municipal Water Finance Authority	5,00 %	15.06.2031	1.104.385	0,08
340.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue	5,25 %	01.11.2048	371.849	0,03
1.125.000	New York State Dormitory Authority	2,69 %	01.07.2040	805.911	0,06
840.000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission	3,22 %	15.02.2048	600.528	0,05
845.000	Ohio University	2,91 %	01.12.2043	580.840	0,04
705.000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue	3,01 %	15.05.2050	467.082	0,04
955.000	State of California	7,63 %	01.03.2040	1.208.422	0,09
530.000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp	3,92 %	31.12.2049	402.986	0,03
845.000	Utah Transit Authority	2,77 %	15.12.2038	642.926	0,05
<b>Kommunalanleihen insgesamt †</b>				<b>20.744.098</b>	<b>1,57</b>
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 0,04 % (31. Dezember 2021: 6,87 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
43.616	Aveanna Healthcare LLC	8,14 %	17.07.2028	33.780	0,00
477.142	Envision Healthcare Corp	8,33 %	31.03.2027	127.237	0,01
271.268	GTT Communications Inc	0,00 %	31.05.2025	126.140	0,01
380.407	Nautilus Power LLC	8,63 %	16.05.2024	292.647	0,02
<b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b>				<b>579.804</b>	<b>0,04</b>
<b>Anzahl der Anteile</b>	<b>Wertpapierbezeichnung</b>			<b>Zeitwert US\$</b>	<b>% des Nettöver- mögens</b>
<b>Investmentfonds 4,40 % (31. Dezember 2021: 4,52 %)</b>					
<b>Britisches Pfund</b>					
861.209	NB Global Monthly Income Fund Ltd			738.685	0,05
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>738.685</b>	<b>0,05</b>

## Strategic Income – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Investmentfonds 4,40 % (31. Dezember 2021: 4,52 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
1.208.113	Neuberger Berman China Bond Fund	11.815.344	0,89
945.691	Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	10.270.208	0,78
486.855	Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	5.477.118	0,42
459.982	Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund	4.921.803	0,37
654.438	Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund	8.062.679	0,61
2.000.000	Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund	16.940.000	1,28
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>57.487.152</b>	<b>4,35</b>
<b>Investmentfonds insgesamt <sup>a</sup></b>		<b>58.225.837</b>	<b>4,40</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>1.421.624.290</b>	<b>107,47</b>

### Devisenterminkontrakte 2,24 % (31. Dezember 2021: 0,18 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
2.587.109 BRL	479.333 US\$	01.03.2023	Citibank NA	1	5.624	0,00
10.704.688 BRL	1.959.573 US\$	02.02.2023	Goldman Sachs International	3	55.851	0,01
1.222.320 BRL	226.965 US\$	02.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	3.167	0,00
2.785.029.812 CLP	3.259.823 US\$	05.01.2023	Goldman Sachs International	1	8.860	0,00
279.115.894 CLP	313.332 US\$	09.02.2023	Morgan Stanley	1	12.989	0,00
764.580 CZK	31.095 €	16.03.2023	Citibank NA	1	303	0,00
13.092.748 CZK	533.252 €	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	7.365	0,00
154.975 €	770.158 RON	09.02.2023	Citibank NA	1	38	0,00
9.096 €	9.707 US\$	04.01.2023	Citibank NA	1	0	0,00
356.964 €	1.772.037 RON	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	502	0,00
166.393 €	827.037 RON	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	13	0,00
627.578 €	650.655 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	19.127	0,00
3.622.319 €	3.608.837 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	260.993	0,02
5.850.002 €	6.492.320 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	2	547.435	0,04
26.703.303 HUF	64.470 €	10.01.2023	Barclays Bank Plc	1	2.188	0,00
582.032.167 HUF	1.356.714 €	16.03.2023	Citibank NA	2	64.848	0,01
75.437.131 HUF	181.098 €	23.01.2023	Citibank NA	1	6.291	0,00
7.725.878.283 IDR	491.754 US\$	30.01.2023	Citibank NA	2	8.067	0,00
4.916.818.715 IDR	315.525 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	2.294	0,00
45.868 ¥	320 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	28	0,00
1.155.844.663 KRW	872.474 US\$	08.02.2023	Goldman Sachs International	4	46.710	0,01
64.500.000 MXN	3.290.615 US\$	05.01.2023	Citibank NA	1	18.655	0,00
6.501.273 MXN	322.128 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	7.233	0,00
2.346.094 MXN	118.288 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	567	0,00
2.423.044 MYR	543.162 US\$	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	11.371	0,00

## Strategic Income – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,24 % (31. Dezember 2021: 0,18 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.808.567 PEN	467.644 US\$	16.03.2023	Barclays Bank Plc	1	3.445	0,00
205.541 PEN	53.163 US\$	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	375	0,00
1.279.738 PLN	268.526 €	20.01.2023	Goldman Sachs International	1	4.460	0,00
1.135.654 PLN	237.903 €	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	4.375	0,00
1.062.949 RON	213.732 €	09.02.2023	Goldman Sachs International	2	118	0,00
2.297.097 RON	461.729 €	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	424	0,00
431.838 SGD	313.243 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	8.875	0,00
4.905.339 THB	140.345 US\$	30.01.2023	Citibank NA	1	1.689	0,00
15.064.620 THB	436.483 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.463	0,00
756.204 US\$	23.013.622 TWD	30.01.2023	Citibank NA	1	5.755	0,00
307.743 US\$	1.624.090 BRL	01.03.2023	Goldman Sachs International	2	3.306	0,00
44.903 US\$	216.876.310 COP	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	486	0,00
223.874 US\$	183.305 €	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	3.289	0,00
8.447.645 ZAR	479.605 US\$	16.03.2023	Barclays Bank Plc	1	13.857	0,00
4.987.688 ZAR	286.795 US\$	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	4.557	0,00
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
2.711.624 AUD	1.774.323 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	65.672	0,00
471.592 AUD	306.414 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	13.588	0,00
79.000.320 AUD	51.261.763 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	30	2.344.551	0,18
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
274.411 €	276.289 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	16.872	0,00
7.889.565 €	7.848.086 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	580.567	0,04
8.622.922 €	8.595.271 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	41	616.847	0,05
262 US\$	245 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
24.074 €	27.548 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	1.422	0,00
907.003 €	1.020.787 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	70.679	0,01
973.262 €	1.101.489 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	69.713	0,01
12.639 US\$	10.472 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	37	0,00
58.634 US\$	48.329 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	477	0,00
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
181.896 HKD	23.195 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	119	0,00
392.271 HKD	50.140 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	137	0,00
20.587.630 HKD	2.627.071 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	11.642	0,00
8.430 US\$	65.691 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	10	0,00
37.282 US\$	290.440 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	11	58	0,00
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
1.256.406.144 ¥	8.850.101 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	690.542	0,05
933.250.298 ¥	6.794.487 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	292.241	0,02
36.740.746.357 ¥	257.101.425 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	21.893.024	1,66
5.958 US\$	780.000 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	35	0,00

## Strategic Income – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,24 % (31. Dezember 2021: 0,18 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
294.355 SGD	218.606 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	937	0,00
950.501 SGD	679.826 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	29.097	0,00
40.640.913 SGD	28.636.264 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	62	1.675.427	0,13
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>29.520.687</b>	<b>2,24</b>

### Futures-Kontrakte 0,22 % (31. Dezember 2021: 0,04 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(81)	Euro-BOBL Future March 2023	307.784	0,02
(64)	Euro-Bund Future March 2023	577.852	0,04
(1)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	29.051	0,00
(3)	Euro-OAT Future March 2023	29.040	0,00
(10)	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	59.748	0,00
(483)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	215.846	0,02
(97)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2023	230.588	0,02
(1.118)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	235.468	0,02
(149)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	98.043	0,01
(148)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	1.121.394	0,09
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>2.904.814</b>	<b>0,22</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,10 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens	
USD	4.205.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Selling default protection on CDX.NA.HY.39	25.894	0,00
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b>				<b>25.894</b>	<b>0,00</b>	

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2021: 0,01 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens	
CAD	13.647.000	17.02.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	2,67 %	3M CDOR	451.266	0,03
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>451.266</b>	<b>0,03</b>	

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.454.526.951</b>	<b>109,96</b>

## Strategic Income – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,54 %) (31. Dezember 2021: (0,35 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.453.564.464 COP	300.644 US\$	09.02.2023	Goldman Sachs International	1	(2.950)	(0,00)
1.288.207.137 COP	266.609 US\$	09.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(2.780)	(0,00)
320.709 €	134.014.323 HUF	23.01.2023	Citibank NA	1	(12.257)	(0,00)
499.777 €	2.384.709 PLN	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(4.359)	(0,00)
277.192 €	114.699.059 HUF	10.01.2023	Goldman Sachs International	1	(9.104)	(0,00)
628.147 €	670.944 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(555)	(0,00)
17.750.000 £	21.830.193 US\$	18.01.2023	Citibank NA	1	(470.256)	(0,04)
56.416.818.715 IDR	3.635.010 US\$	05.01.2023	Citibank NA	2	(6.519)	(0,00)
2.622.952 ILS	768.631 US\$	16.03.2023	Citibank NA	1	(22.310)	(0,00)
435.418 ILS	128.433 US\$	16.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(4.541)	(0,00)
4.243.215 RON	854.198 €	09.02.2023	UBS AG	1	(594)	(0,00)
3.367.995 THB	98.229 US\$	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(708)	(0,00)
1.157.520 TRY	59.475 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(835)	(0,00)
5.807.680 TWD	190.967 US\$	30.01.2023	Citibank NA	1	(1.585)	(0,00)
349.698 US\$	332.714 €	04.01.2023	Citibank NA	1	(5.391)	(0,00)
320.367 US\$	318.919 €	20.01.2023	Citibank NA	1	(20.394)	(0,00)
315.743 US\$	4.916.818.715 IDR	05.01.2023	Citibank NA	1	(486)	(0,00)
329.034 US\$	1.777.533 BRL	01.03.2023	Goldman Sachs International	1	(4.167)	(0,00)
68.791 US\$	265.510 PEN	16.03.2023	Goldman Sachs International	1	(368)	(0,00)
1.337.638 US\$	26.911.456 TRY	15.03.2023	Goldman Sachs International	2	(25.719)	(0,00)
30.668.958 US\$	30.877.177 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	7	(2.318.034)	(0,18)
5.523.496 US\$	4.925.172 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(403.340)	(0,03)
71.624 US\$	1.123.705.842 IDR	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.074)	(0,00)
558.752 US\$	536.134 €	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(13.437)	(0,00)
568.131 US\$	748.313.100 KRW	08.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(26.965)	(0,00)
249.860 US\$	239.985 €	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(6.523)	(0,00)
4.958 US\$	52.924 NOK	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(417)	(0,00)
26.469.760 US\$	23.600.000 £	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(1.929.929)	(0,15)
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
426.039 AUD	290.144 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(1.052)	(0,00)
2.100.000 AUD	1.432.925 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	(7.952)	(0,00)
1.856.775 US\$	2.848.990 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	(76.430)	(0,01)
362.056 US\$	557.635 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(16.332)	(0,00)
1.887.106 US\$	2.825.142 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	10	(29.917)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
96.896 €	103.586 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(69)	(0,00)
263.047 US\$	260.265 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(15.001)	(0,00)
136.306 US\$	127.612 €	18.01.2023	UBS AG	1	(26)	(0,00)
1.495.887 US\$	1.482.155 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	38	(87.545)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
41.404 £	50.969 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(1.146)	(0,00)

## Strategic Income – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,54 %) (31. Dezember 2021: (0,35 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>						
103.711 US\$	90.846 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(5.612)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
61.378 HKD	7.882 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(15)	(0,00)
70.875 HKD	9.116 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(32)	(0,00)
193.840 HKD	24.901 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	12	(55)	(0,00)
17.194 US\$	134.799 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(83)	(0,00)
17.860 US\$	140.011 HKD	18.01.2023	UBS AG	2	(84)	(0,00)
1.202.559 US\$	9.424.424 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	(5.368)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
10.051.272 US\$	1.398.548.355 ¥	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(568.742)	(0,04)
5.498.395 US\$	800.851.254 ¥	18.01.2023	UBS AG	3	(582.947)	(0,05)
6.087.162 US\$	850.911.247 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(374.315)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
449.785 US\$	633.478 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(22.690)	(0,00)
346.571 US\$	495.494 SGD	18.01.2023	UBS AG	2	(22.989)	(0,00)
1.593.580 US\$	2.200.298 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	60	(47.492)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(7.161.491)</b>	<b>(0,54)</b>

### Futures-Kontrakte (0,11 %) (31. Dezember 2021: (0,32 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
161	Euro-BOBL Future March 2023	(609.987)	(0,05)
37	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	(175.318)	(0,01)
1.089	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	(640.537)	(0,05)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>			<b>(1.425.842) (0,11)</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
EUR 8.405.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover S38	(97.587)	(0,01)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b>				<b>(97.587)</b>	<b>(0,01)</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Strategic Income – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2021: (0,02 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
BRL	2.262.674	02.01.2031	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,21 %	1D BROIS	(50.778)	(0,00)
BRL	3.860.376	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,17 %	1D BROIS	(200.917)	(0,02)
BRL	6.266.079	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,17 %	1D BROIS	(213.207)	(0,02)
CAD	13.647.000	17.02.2027	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,67 %	3M CDOR	(451.285)	(0,03)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>							<b>(916.187)</b>	<b>(0,07)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Total Return Swap-Kontrakte (0,29 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

	Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens	
USD	38.600.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup>	(955.914)	(0,07)	
USD	88.080.000	20.03.2023	4,30 <sup>1</sup>	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index <sup>2</sup>	(2.908.035)	(0,22)	
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>(3.863.949)</b>	<b>(0,29)</b>

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(13.465.056)</b>	<b>(1,02)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>1.441.061.895</b>	<b>108,94</b>
<b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>	<b>(118.256.040)</b>	<b>(8,94)</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>1.322.805.855</b>	<b>100,00</b>

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2022 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	430.570.333	26,64
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	910.254.980	56,32
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	22.573.140	1,40
µ Investmentfonds	58.225.837	3,60
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.478.972	0,09
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	17.958.633	1,11
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>1.441.061.895</b>	<b>89,16</b>

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 86,13 % (31. Dezember 2021: 84,86 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
240.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	218.400	0,68
600.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy*	6,25 %	10.12.2024	586.200	1,84
700.000	Agile Group Holdings Ltd*	6,05 %	13.10.2025	324.747	1,02
300.000	Agile Group Holdings Ltd*	8,38 %	29.12.2049	75.836	0,24
600.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	502.696	1,57
600.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	3,75 %	30.03.2026	558.028	1,75
350.000	CA Magnum Holdings**	5,38 %	31.10.2026	319.805	1,00
850.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	29.12.2049	665.023	2,08
510.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd*	4,88 %	17.08.2026	488.374	1,53
200.000	Celestial Miles Ltd*	5,75 %	29.12.2049	192.000	0,60
300.000	Central Plaza Development Ltd*	5,75 %	29.12.2049	235.501	0,74
200.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	187.161	0,59
1.100.000	China SCE Group Holdings Ltd*	7,00 %	02.05.2025	440.000	1,38
448.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95 %	20.10.2025	118.436	0,37
677.250	Continuum Energy Levanter Pte Ltd*	4,50 %	09.02.2027	608.702	1,91
350.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	4,80 %	06.08.2030	187.036	0,59
450.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	5,13 %	17.01.2025	304.794	0,95
900.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	5,13 %	14.01.2027	521.570	1,63
300.000	Elect Global Investments Ltd*	4,10 %	29.12.2049	259.995	0,81
500.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	436.122	1,37
200.000	Fortune Star BVI Ltd*	5,95 %	19.10.2025	154.790	0,48
500.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	397.560	1,25
310.000	FWD Group Ltd*	5,75 %	09.07.2024	297.545	0,93
530.000	FWD Group Ltd*	8,05 %	29.12.2049	484.595	1,52
300.000	GENM Capital Labuan Ltd*	3,88 %	19.04.2031	223.621	0,70
729.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	654.277	2,05
300.000	GLP Pte Ltd*	4,50 %	29.12.2049	153.954	0,48
382.000	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	332.320	1,04
1.527.482	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	1.282.821	4,02
300.000	Greenko Solar Mauritius Ltd*	5,95 %	29.07.2026	274.875	0,86
200.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	189.763	0,59
619.500	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13 %	18.05.2031	517.250	1,62
600.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	475.969	1,49
700.000	Kasikornbank PCL*	3,34 %	02.10.2031	616.885	1,93
200.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	158.918	0,50
273.000	Lenovo Group Ltd*	5,83 %	27.01.2028	264.162	0,83
200.000	Longfor Group Holdings Ltd*	3,95 %	16.09.2029	147.000	0,46
900.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38 %	30.01.2027	815.033	2,55
500.000	Medco Oak Tree Pte Ltd*	7,38 %	14.05.2026	476.875	1,49
300.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	231.633	0,73



## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 86,13 % (31. Dezember 2021: 84,86 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
500.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,38 %	04.12.2029	402.045	1,26
400.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	343.696	1,08
800.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75 %	21.07.2028	670.175	2,10
200.000	MGM China Holdings Ltd**	4,75 %	01.02.2027	177.188	0,56
560.000	MGM China Holdings Ltd*	5,88 %	15.05.2026	523.828	1,64
600.000	Network i2i Ltd*	5,65 %	29.12.2049	575.250	1,80
200.000	New Metro Global Ltd*	4,80 %	15.12.2024	155.143	0,49
400.000	NWD Finance BVI Ltd*	4,13 %	29.12.2049	294.000	0,92
260.000	NWD MTN Ltd*	4,13 %	18.07.2029	212.874	0,67
700.000	PCPD Capital Ltd*	5,13 %	18.06.2026	532.000	1,67
600.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	562.146	1,76
200.000	Philippine National Bank*	3,28 %	27.09.2024	188.998	0,59
200.000	ReNew Power Pvt Ltd*	5,88 %	05.03.2027	192.250	0,60
600.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries*	4,50 %	14.07.2028	504.220	1,58
981.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd*	5,20 %	12.01.2026	708.898	2,22
200.000	Sands China Ltd**	3,75 %	08.08.2031	157.651	0,49
1.300.000	Sands China Ltd*	5,90 %	08.08.2028	1.218.962	3,82
330.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	317.846	1,00
450.000	Shui On Development Holding Ltd*	6,15 %	24.08.2024	394.717	1,24
400.000	Singapore Airlines Ltd*	3,38 %	19.01.2029	361.528	1,13
350.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd*	6,00 %	30.07.2024	225.750	0,71
800.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd*	2,70 %	13.01.2025	462.170	1,45
648.640	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd*	6,75 %	24.04.2033	614.315	1,92
200.000	Studio City Finance Ltd*	6,00 %	15.07.2025	173.721	0,54
400.000	Studio City Finance Ltd*	6,50 %	15.01.2028	311.240	0,97
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*	3,98 %	09.11.2027	173.025	0,54
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	174.428	0,55
300.000	Wynn Macau Ltd*	4,88 %	01.10.2024	283.715	0,89
300.000	Wynn Macau Ltd*	5,50 %	01.10.2027	262.701	0,82
600.000	Wynn Macau Ltd*	5,63 %	26.08.2028	513.777	1,61
510.000	Yanlord Land HK Co Ltd*	5,13 %	20.05.2026	426.487	1,34
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>27.495.016</b>	<b>86,13</b>
<b>Staatsanleihen 2,63 % (31. Dezember 2021: 5,00 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
600.000	Sri Lanka Government International Bond	5,75 %	18.04.2023	190.474	0,60
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,88 %	21.02.2023	66.027	0,21
600.000	Sri Lanka Government International Bond	6,13 %	03.06.2025	196.419	0,61
600.000	Sri Lanka Government International Bond	6,85 %	03.11.2025	193.556	0,61

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 2,63 % (31. Dezember 2021: 5,00 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
600.000	Sri Lanka Government International Bond	7,55 %	28.03.2030	191.448	0,60
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>837.924</b>	<b>2,63</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>28.332.940</b>	<b>88,76</b>

Devisenterminkontrakte 0,88 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
167.090 €	174.601 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	3.906	0,01
40.314 €	42.405 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	664	0,00
3.821.074 €	3.819.637 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	262.526	0,82
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
2.257 £	2.512 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	204	0,00
98.222 £	110.605 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	7.594	0,03
115.863 £	132.007 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	10	7.421	0,02
1.254 US\$	1.024 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	22	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>282.337</b>	<b>0,88</b>

Futures-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2021: 0,01 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens	
(6)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	12.797	0,04	
(2)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	325	0,00	
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>			<b>13.122</b>	<b>0,04</b>

				Zeitwert% US\$	des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>				<b>28.628.399</b>	<b>89,68</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,09 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
22.963 €	24.619 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(87)	(0,00)
177.380 US\$	176.154 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(10.810)	(0,04)
19.164 US\$	18.117 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(191)	(0,00)
200.877 US\$	203.554 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	(16.586)	(0,05)

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,09 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
13.077 £	15.997 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	7	(260)	(0,00)
7.159 US\$	6.257 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(370)	(0,00)
15.901 US\$	13.983 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	10	(925)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(29.229)</b>	<b>(0,09)</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(29.229)</b>	<b>(0,09)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>28.599.170</b>	<b>89,59</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>3.323.101</b>	<b>10,41</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>31.922.271</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	26.499.584	82,46
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.833.356	5,70
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	13.122	0,04
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	253.108	0,79
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>28.599.170</b>	<b>88,99</b>

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %)</b>				
<b>US-Dollar</b>				
1.000.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40 %	09.03.2023	979.077 1,00
391.000	ABQ Finance Ltd*	3,13 %	24.09.2024	375.706 0,38
268.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	4,50 %	14.09.2027	264.618 0,27
300.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60 %	02.11.2047	276.573 0,28
216.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	2,00 %	29.04.2028	192.304 0,20
278.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	4,88 %	23.04.2030	287.052 0,29
200.000	Access Bank Plc*	6,13 %	21.09.2026	155.800 0,16
300.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy*	6,25 %	10.12.2024	292.637 0,30
368.000	Aegea Finance Sarl*	6,75 %	20.05.2029	363.516 0,37
217.000	Africa Finance Corp*	2,88 %	28.04.2028	187.357 0,19
335.000	African Export-Import Bank*	3,99 %	21.09.2029	291.707 0,30
200.000	Agile Group Holdings Ltd*	8,38 %	29.12.2049	50.557 0,05
303.000	AIA Group Ltd*	2,70 %	29.12.2049	262.865 0,27
300.000	AIA Group Ltd**	3,60 %	09.04.2029	273.156 0,28
352.000	Akbank TAS**	6,80 %	06.02.2026	340.905 0,35
363.669	Alfa Desarrollo SpA**	4,55 %	27.09.2051	276.987 0,28
450.000	Alfa SAB de CV**	6,88 %	25.03.2044	440.266 0,45
427.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00 %	06.12.2037	357.007 0,36
200.000	Alpek SAB de CV*	3,25 %	25.02.2031	166.943 0,17
357.000	Alpek SAB de CV**	4,25 %	18.09.2029	324.611 0,33
206.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	204.603 0,21
400.000	Altice Financing SA*	5,00 %	15.01.2028	322.860 0,33
200.000	Altice Financing SA**	5,75 %	15.08.2029	157.688 0,16
300.000	America Movil SAB de CV*	4,70 %	21.07.2032	288.333 0,29
400.000	America Movil SAB de CV**	5,38 %	04.04.2032	361.578 0,37
400.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,38 %	01.11.2028	349.432 0,36
260.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,75 %	01.10.2030	225.727 0,23
388.000	Antofagasta Plc*	5,63 %	13.05.2032	381.033 0,39
381.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63 %	07.10.2026	346.854 0,35
200.000	Axiata Spv5 Labuan Ltd*	3,06 %	19.08.2050	132.691 0,14
200.000	Azul Investments LLP**	7,25 %	15.06.2026	122.250 0,12
359.000	Banco Bradesco SA**	4,38 %	18.03.2027	344.791 0,35
200.000	Banco Davivienda SA**	6,65 %	29.12.2049	154.500 0,16
350.000	Banco de Bogota SA*	6,25 %	12.05.2026	343.803 0,35
400.000	Banco de Credito del Peru SA**	3,13 %	01.07.2030	363.164 0,37
435.000	Banco de Credito e Inversiones SA**	2,88 %	14.10.2031	362.488 0,37
300.000	Banco do Brasil SA*	6,25 %	29.12.2049	269.940 0,27
270.000	Banco do Brasil SA**	9,00 %	29.12.2049	270.571 0,28
300.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank**	3,25 %	04.10.2026	273.437 0,28

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
384.000	Banco Mercantil del Norte SA**	6,63 %	29.12.2049	318.651	0,32
250.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,63 %	29.12.2049	234.592	0,24
241.000	Banco Santander Chile**	3,18 %	26.10.2031	205.760	0,21
200.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand**	5,38 %	17.04.2025	198.340	0,20
595.000	Bancolombia SA*	4,63 %	18.12.2029	523.924	0,53
200.000	Bancolombia SA*	7,14 %	18.10.2027	197.197	0,20
848.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	710.476	0,72
320.000	Bangkok Bank PCL*	4,30 %	15.06.2027	308.422	0,31
200.000	Bank Hapoalim BM*	3,26 %	21.01.2032	172.744	0,18
285.000	Bank Leumi Le-Israel BM*	3,28 %	29.01.2031	253.537	0,26
204.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	3,75 %	11.04.2024	199.844	0,20
333.000	Bank Muscat SAOG*	4,75 %	17.03.2026	318.298	0,32
413.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	3,75 %	30.03.2026	383.837	0,39
200.000	BBK BSC*	5,50 %	09.07.2024	196.079	0,20
400.000	BBVA Bancomer SA**	5,13 %	18.01.2033	359.730	0,37
300.000	Becle SAB de CV**	2,50 %	14.10.2031	233.534	0,24
200.000	Bharti Airtel Ltd**	3,25 %	03.06.2031	169.393	0,17
249.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	225.001	0,23
700.000	BOC Aviation Ltd*	3,00 %	11.09.2029	607.309	0,62
405.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	18.09.2027	372.453	0,38
237.000	Braskem Idesa SAPI**	6,99 %	20.02.2032	169.624	0,17
325.000	Braskem Netherlands Finance BV**	8,50 %	23.01.2081	315.429	0,32
385.000	BSF Finance*	5,50 %	23.11.2027	389.990	0,40
400.000	C&W Senior Financing DAC**	6,88 %	15.09.2027	372.872	0,38
200.000	CA Magnum Holdings**	5,38 %	31.10.2026	182.746	0,19
200.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	176.953	0,18
200.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	29.12.2049	157.238	0,16
200.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd*	4,88 %	17.08.2026	191.706	0,20
302.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	15.09.2025	276.694	0,28
321.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	12.05.2026	289.520	0,29
574.000	Celestial Miles Ltd*	5,75 %	29.12.2049	551.040	0,56
300.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA**	4,25 %	30.04.2029	281.564	0,29
200.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	185.057	0,19
200.000	Cemex SAB de CV**	5,45 %	19.11.2029	192.575	0,20
200.000	Cemex SAB de CV**	7,38 %	05.06.2027	205.576	0,21
400.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	379.188	0,39
200.000	Cencosud SA**	6,63 %	12.02.2045	194.990	0,20
300.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	280.271	0,29

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
200.000	Central Plaza Development Ltd*	5,75 %	29.12.2049	157.000	0,16
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd*	4,75 %	08.02.2028	190.201	0,19
500.000	China Construction Bank Corp*	2,45 %	24.06.2030	468.906	0,48
400.000	China Development Bank Financial Leasing Co Ltd*	2,88 %	28.09.2030	372.632	0,38
350.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	325.260	0,33
200.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd*	6,45 %	11.06.2034	191.017	0,19
200.000	China SCE Group Holdings Ltd*	7,00 %	02.05.2025	80.000	0,08
200.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,13 %	03.06.2026	181.064	0,18
207.000	CIBANCO SA Institucion de Banca Multiple Trust CIB/3332**	4,38 %	22.07.2031	155.076	0,16
300.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95 %	20.10.2025	79.310	0,08
200.000	CK Hutchison International 21 Ltd*	2,50 %	15.04.2031	165.726	0,17
320.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	290.683	0,30
362.000	Colombia Telecomunicaciones SA ESP**	4,95 %	17.07.2030	289.553	0,29
400.000	Commercial Bank PSQC*	4,50 %	29.12.2049	360.216	0,37
415.000	Compania Cervecerias Unidas SA**	3,35 %	19.01.2032	350.619	0,36
290.250	Continuum Energy Levanter Pte Ltd*	4,50 %	09.02.2027	260.872	0,27
353.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	4,80 %	06.08.2030	188.639	0,19
239.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	228.585	0,23
400.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	317.308	0,32
555.000	CT Trust**	5,13 %	03.02.2032	488.143	0,50
300.000	DBS Group Holdings Ltd*	1,82 %	10.03.2031	267.021	0,27
200.000	DBS Group Holdings Ltd*	4,52 %	11.12.2028	197.970	0,20
323.000	DIB Sukuk Ltd*	1,96 %	22.06.2026	290.579	0,30
308.000	DIB Sukuk Ltd*	5,49 %	30.11.2027	314.027	0,32
250.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd*	6,25 %	29.12.2049	250.594	0,26
273.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13 %	30.06.2028	226.718	0,23
263.000	Ecopetrol SA*	4,63 %	02.11.2031	201.428	0,21
380.000	Ecopetrol SA*	5,88 %	28.05.2045	265.405	0,27
200.000	Ecopetrol SA*	6,88 %	29.04.2030	181.824	0,19
300.000	Ecopetrol SA*	7,38 %	18.09.2043	256.244	0,26
200.000	EI Sukuk Co Ltd*	1,83 %	23.09.2025	183.798	0,19
224.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	4,39 %	30.11.2046	172.666	0,18
275.000	Elect Global Investments Ltd*	4,10 %	29.12.2049	238.329	0,24
292.000	Emaar Sukuk Ltd*	3,88 %	17.09.2029	271.209	0,28
300.000	Emirates Development Bank PJSC*	3,52 %	06.03.2024	293.972	0,30
400.000	Emirates NBD Bank PJSC*	4,25 %	29.12.2049	356.500	0,36
329.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,63 %	21.10.2027	338.054	0,34
500.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	494.071	0,50

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
531.000	Endeavour Mining Plc*	5,00 %	14.10.2026	457.350	0,47
205.000	Enel Chile SA*	4,88 %	12.06.2028	200.135	0,20
396.835	Energean Israel Finance Ltd*	4,88 %	30.03.2026	365.961	0,37
200.000	Energean Israel Finance Ltd*	5,88 %	30.03.2031	175.375	0,18
280.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	244.228	0,25
200.000	Equate Petrochemical BV*	2,63 %	28.04.2028	174.731	0,18
304.000	Falabella SA**	3,38 %	15.01.2032	243.492	0,25
406.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	5,13 %	13.10.2027	414.428	0,42
688.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	15.10.2027	646.915	0,66
296.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	288.718	0,29
200.000	FirstRand Bank Ltd*	6,25 %	23.04.2028	198.700	0,20
500.000	Formosa Group Cayman Ltd*	3,38 %	22.04.2025	474.017	0,48
400.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	318.643	0,32
350.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	352.016	0,35
300.000	FWD Group Ltd*	5,75 %	09.07.2024	287.823	0,29
300.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	242.270	0,25
289.959	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94 %	30.09.2040	234.076	0,24
600.000	GC Treasury Center Co Ltd*	2,98 %	18.03.2031	485.415	0,49
380.000	GC Treasury Center Co Ltd*	4,40 %	30.03.2032	337.586	0,34
234.000	GCC SAB de CV**	3,61 %	20.04.2032	195.082	0,20
200.000	GENM Capital Labuan Ltd*	3,88 %	19.04.2031	149.081	0,15
360.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	323.100	0,33
250.000	Gohl Capital Ltd*	4,25 %	24.01.2027	228.947	0,23
114.000	Gol Finance SA*	7,00 %	31.01.2025	50.635	0,05
200.000	Gol Finance SA**	8,00 %	30.06.2026	117.915	0,12
226.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	6,13 %	15.05.2029	229.449	0,23
573.000	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	495.819	0,51
190.896	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	160.320	0,16
300.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	243.915	0,25
350.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA*	5,50 %	29.04.2026	338.321	0,34
300.000	Grupo Televisa SAB*	6,63 %	15.01.2040	308.846	0,31
273.171	Guara Norte Sarl**	5,20 %	15.06.2034	231.533	0,24
200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	3,38 %	04.02.2032	166.322	0,17
245.000	HDFC Bank Ltd*	3,70 %	29.12.2049	210.823	0,21
200.000	HKT Capital No 2 Ltd*	3,63 %	02.04.2025	189.592	0,19
203.000	HPHT Finance 21 Ltd*	2,00 %	19.03.2026	183.711	0,19
275.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	260.924	0,27
437.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38 %	01.06.2028	417.310	0,43

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
300.000	Hyundai Capital America**	3,50 %	02.11.2026	276.063	0,28
291.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	257.154	0,26
216.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,40 %	09.06.2031	179.872	0,18
411.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,54 %	27.04.2032	339.205	0,35
233.000	Industrias Penoles SAB de CV**	4,75 %	06.08.2050	192.583	0,20
300.000	InRetail Consumer**	3,25 %	22.03.2028	258.384	0,26
300.000	Inversiones CMPC SA**	3,00 %	06.04.2031	253.571	0,26
200.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25 %	26.04.2029	191.483	0,20
313.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc**	3,63 %	15.01.2032	253.982	0,26
400.000	JMH Co Ltd*	2,50 %	09.04.2031	326.373	0,33
240.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	190.387	0,19
350.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	322.412	0,33
200.000	Klabn Austria GmbH**	3,20 %	12.01.2031	160.260	0,16
223.000	Kookmin Bank*	2,50 %	04.11.2030	177.965	0,18
226.000	Kookmin Bank*	4,35 %	29.12.2049	211.659	0,22
307.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	262.203	0,27
224.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40 %	29.12.2049	199.360	0,20
400.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	317.836	0,32
171.671	Leviathan Bond Ltd*	6,50 %	30.06.2027	166.665	0,17
309.038	Leviathan Bond Ltd*	6,75 %	30.06.2030	292.546	0,30
229.000	LG Chem Ltd*	2,38 %	07.07.2031	180.456	0,18
200.000	Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA*	4,38 %	18.06.2026	167.681	0,17
200.000	Longfor Group Holdings Ltd*	3,95 %	16.09.2029	147.238	0,15
258.000	MAF Global Securities Ltd*	7,88 %	29.12.2049	261.390	0,27
200.000	MAF Sukuk Ltd*	4,64 %	14.05.2029	195.145	0,20
400.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	308.611	0,32
246.000	Mashreqbank PSC*	4,25 %	26.02.2024	241.992	0,25
382.000	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	315.745	0,32
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	5,50 %	28.04.2033	211.867	0,22
200.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38 %	30.01.2027	181.118	0,18
479.000	Medco Oak Tree Pte Ltd*	7,38 %	14.05.2026	456.846	0,46
322.000	MEGlobal Canada ULC*	5,88 %	18.05.2030	324.792	0,33
204.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	157.511	0,16
550.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	472.582	0,48
550.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75 %	21.07.2028	460.746	0,47
200.000	MGM China Holdings Ltd**	4,75 %	01.02.2027	177.188	0,18
200.000	MGM China Holdings Ltd*	5,88 %	15.05.2026	187.081	0,19
235.000	Millicom International Cellular SA**	4,50 %	27.04.2031	198.080	0,20



## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
200.700	Millicom International Cellular SA*	6,25 %	25.03.2029	192.246	0,20
479.000	Minera Mexico SA de CV**	4,50 %	26.01.2050	362.495	0,37
494.000	Minerva Luxembourg SA*	4,38 %	18.03.2031	406.303	0,41
400.000	Minsur SA**	4,50 %	28.10.2031	348.078	0,35
290.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd*	3,08 %	07.04.2031	255.563	0,26
246.000	MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA**	6,88 %	01.02.2025	167.061	0,17
300.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	6,50 %	13.10.2026	300.526	0,31
428.250	MV24 Capital BV*	6,75 %	01.06.2034	392.078	0,40
230.021	Nakilat Inc**	6,07 %	31.12.2033	237.673	0,24
388.000	NBK SPC Ltd*	1,63 %	15.09.2027	341.944	0,35
359.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50 %	29.12.2049	330.557	0,34
370.000	Nemak SAB de CV**	3,63 %	28.06.2031	289.962	0,30
200.000	Network i2i Ltd*	5,65 %	29.12.2049	191.750	0,20
200.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	187.576	0,19
343.000	Nexa Resources SA**	6,50 %	18.01.2028	334.653	0,34
377.000	NWD MTN Ltd*	4,13 %	18.07.2029	306.373	0,31
200.000	Oil India International Pte Ltd*	4,00 %	21.04.2027	185.183	0,19
200.000	Oil India Ltd*	5,13 %	04.02.2029	190.648	0,19
294.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63 %	08.04.2031	253.349	0,26
338.000	Orbia Advance Corp SAB de CV**	2,88 %	11.05.2031	264.551	0,27
272.000	Oryx Funding Ltd*	5,80 %	03.02.2031	260.402	0,27
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83 %	10.09.2030	179.657	0,18
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,25 %	19.06.2024	197.686	0,20
262.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,60 %	15.06.2032	251.520	0,26
283.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	284.779	0,29
300.000	Periana Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	281.174	0,29
233.000	Petrofac Ltd**	9,75 %	15.11.2026	131.976	0,13
342.000	Philippine National Bank*	3,28 %	27.09.2024	323.313	0,33
200.000	Power Finance Corp Ltd*	4,50 %	18.06.2029	184.959	0,19
200.000	Prosus NV*	3,83 %	08.02.2051	121.528	0,12
400.000	Prudential Plc*	2,95 %	03.11.2033	328.033	0,33
200.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd*	3,90 %	06.12.2059	135.089	0,14
300.000	QIB Sukuk Ltd*	3,98 %	26.03.2024	295.094	0,30
241.000	QNB Finance Ltd*	2,63 %	12.05.2025	228.125	0,23
367.000	QNB Finance Ltd*	2,75 %	12.02.2027	337.464	0,34
291.000	QNB Finance Ltd*	3,50 %	28.03.2024	285.158	0,29
390.000	REC Ltd*	2,25 %	01.09.2026	344.652	0,35
295.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50 %	22.01.2030	254.582	0,26

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
450.000	Reliance Industries Ltd <sup>†</sup>	2,88 %	12.01.2032	365.250	0,37
378.000	Reliance Industries Ltd <sup>†</sup>	3,63 %	12.01.2052	248.765	0,25
200.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries <sup>†</sup>	4,50 %	14.07.2028	168.073	0,17
337.000	SABIC Capital I BV <sup>†</sup>	2,15 %	14.09.2030	285.013	0,29
231.000	Sable International Finance Ltd <sup>**</sup>	5,75 %	07.09.2027	213.502	0,22
200.000	Sagcor Financial Co Ltd <sup>**</sup>	5,30 %	13.05.2028	187.654	0,19
200.000	Sands China Ltd <sup>**</sup>	3,35 %	08.03.2029	163.662	0,17
200.000	Sands China Ltd <sup>**</sup>	4,30 %	08.01.2026	184.830	0,19
275.000	Sands China Ltd <sup>†</sup>	5,63 %	08.08.2025	263.283	0,27
950.000	Sands China Ltd <sup>†</sup>	5,90 %	08.08.2028	890.780	0,91
250.000	Sasol Financing USA LLC <sup>†</sup>	6,50 %	27.09.2028	227.523	0,23
475.000	SEPLAT Energy Plc <sup>†</sup>	7,75 %	01.04.2026	383.188	0,39
232.000	SF Holding Investment 2021 Ltd <sup>†</sup>	3,13 %	17.11.2031	194.266	0,20
200.000	Shanghai Port Group BVI Development Co Ltd <sup>†</sup>	2,85 %	11.09.2029	174.992	0,18
200.000	Shelf Drilling Holdings Ltd <sup>**</sup>	8,25 %	15.02.2025	173.885	0,18
600.000	Shinhan Bank Co Ltd <sup>†</sup>	4,38 %	13.04.2032	536.078	0,55
446.000	Shinhan Financial Group Co Ltd <sup>†</sup>	5,88 %	29.12.2049	441.540	0,45
300.000	Shriram Finance Ltd <sup>†</sup>	4,40 %	13.03.2024	288.951	0,29
200.000	Siam Commercial Bank PCL <sup>†</sup>	4,40 %	11.02.2029	189.897	0,19
600.000	SierraCol Energy Andina LLC <sup>**</sup>	6,00 %	15.06.2028	471.633	0,48
200.000	Sigma Finance Netherlands BV <sup>†</sup>	4,88 %	27.03.2028	189.856	0,19
200.000	Simpar Europe SA <sup>**</sup>	5,20 %	26.01.2031	151.766	0,15
250.000	Singapore Airlines Ltd <sup>†</sup>	3,38 %	19.01.2029	224.082	0,23
400.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd <sup>†</sup>	1,88 %	10.06.2030	323.131	0,33
200.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd <sup>†</sup>	2,70 %	13.01.2025	115.542	0,12
500.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd <sup>†</sup>	2,30 %	08.01.2031	420.955	0,43
208.000	SK Battery America Inc <sup>†</sup>	2,13 %	26.01.2026	179.087	0,18
566.000	SK Hynix Inc <sup>†</sup>	2,38 %	19.01.2031	415.528	0,42
250.000	SNB Funding Ltd <sup>†</sup>	2,75 %	02.10.2024	239.340	0,24
300.000	SNB Funding Ltd <sup>†</sup>	2,90 %	29.01.2027	278.327	0,28
446.000	SNB Sukuk Ltd <sup>†</sup>	2,34 %	19.01.2027	405.596	0,41
300.000	Southern Copper Corp <sup>†</sup>	6,75 %	16.04.2040	335.592	0,34
536.000	Stillwater Mining Co <sup>†</sup>	4,00 %	16.11.2026	474.009	0,48
200.000	StoneCo Ltd <sup>**</sup>	3,95 %	16.06.2028	159.862	0,16
200.000	Studio City Finance Ltd <sup>†</sup>	6,00 %	15.07.2025	173.721	0,18
200.000	Studio City Finance Ltd <sup>†</sup>	6,50 %	15.01.2028	155.620	0,16
200.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd <sup>†</sup>	3,75 %	25.02.2029	182.046	0,19
371.000	Suzano Austria GmbH <sup>†</sup>	5,00 %	15.01.2030	348.007	0,35

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
276.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	275.979	0,28
129.000	Telecom Argentina SA**	8,00 %	18.07.2026	122.235	0,12
220.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	198.006	0,20
390.000	Telefonica Celular del Paraguay SA**	5,88 %	15.04.2027	378.191	0,39
200.000	Telefonica Moviles Chile SA**	3,54 %	18.11.2031	164.138	0,17
283.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	179.440	0,18
429.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25 %	15.08.2030	306.962	0,31
700.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	3,15 %	01.10.2026	613.571	0,62
550.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,10 %	01.10.2046	337.480	0,34
560.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,13 %	31.01.2025	557.771	0,57
710.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	441.982	0,45
200.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	156.449	0,16
300.000	Transportadora de Gas del Sur SA*	6,75 %	02.05.2025	277.599	0,28
400.000	Trust Fibra Uno**	4,87 %	15.01.2030	344.210	0,35
500.000	TSMC Arizona Corp*	1,75 %	25.10.2026	446.734	0,45
400.000	TSMC Arizona Corp*	2,50 %	25.10.2031	328.397	0,33
550.000	TSMC Arizona Corp*	3,25 %	25.10.2051	397.866	0,41
893.000	TSMC Arizona Corp*	4,25 %	22.04.2032	866.165	0,88
1.000.000	TSMC Global Ltd*	2,25 %	23.04.2031	812.595	0,83
200.000	Turk Telekomunikasyon AS*	6,88 %	28.02.2025	189.246	0,19
200.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	173.863	0,18
245.000	Turkiye Is Bankasi AS*	6,13 %	25.04.2024	243.499	0,25
200.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50 %	18.10.2024	192.169	0,20
215.000	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*	6,95 %	14.03.2026	210.232	0,21
457.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,50 %	01.10.2026	410.359	0,42
400.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75 %	01.10.2026	398.417	0,41
400.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00 %	14.10.2031	349.611	0,36
300.000	United Overseas Bank Ltd*	3,75 %	15.04.2029	292.385	0,30
500.000	United Overseas Bank Ltd*	3,86 %	07.10.2032	461.535	0,47
185.000	Vale Overseas Ltd*	6,88 %	21.11.2036	195.617	0,20
600.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	523.285	0,53
921.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	361.460	0,37
200.000	Wharf REIC Finance BVI Ltd*	3,50 %	17.01.2028	182.186	0,19
300.000	Woori Bank*	4,75 %	30.04.2024	295.332	0,30
785.000	Wynn Macau Ltd*	5,63 %	26.08.2028	672.192	0,68
200.000	XP Inc**	3,25 %	01.07.2026	179.994	0,18
300.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	8,25 %	15.10.2024	306.222	0,31
100.000	YPF SA*	6,95 %	21.07.2027	71.000	0,07

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 88,54 % (31. Dezember 2021: 95,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
250.000	YPF SA**	7,00 %	15.12.2047	150.333	0,15
187.500	YPF SA*	8,50 %	23.03.2025	171.341	0,17
285.000	YPF SA*	8,50 %	28.07.2025	239.465	0,24
300.000	YPF SA**	9,00 %	30.06.2029	240.251	0,24
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>86.982.672</b>	<b>88,54</b>
<b>Staatsanleihen 4,48 % (31. Dezember 2021: 1,95 %)</b>					
<b>Euro</b>					
194.000	Argentine Republic Government International Bond	0,13 %	09.07.2030	52.256	0,06
6.298	Argentine Republic Government International Bond	0,50 %	09.07.2029	1.713	0,00
1.175.000	Ivory Coast Government International Bond	5,25 %	22.03.2030	1.062.606	1,08
1.375.000	Romanian Government International Bond	3,62 %	26.05.2030	1.208.940	1,23
<b>Euro insgesamt</b>				<b>2.325.515</b>	<b>2,37</b>
<b>US-Dollar</b>					
300.000	Airport Authority	3,25 %	12.01.2052	212.662	0,22
200.000	Angolan Government International Bond	8,75 %	14.04.2032	173.910	0,18
579.253	Argentine Republic Government International Bond	0,50 %	09.07.2030	157.667	0,16
107.488	Argentine Republic Government International Bond	1,00 %	09.07.2029	28.802	0,03
439.246	Argentine Republic Government International Bond	1,50 %	09.07.2035	112.511	0,11
452.025	Argentine Republic Government International Bond	3,50 %	09.07.2041	128.641	0,13
415.685	Argentine Republic Government International Bond	3,88 %	09.01.2038	132.534	0,14
656.000	Colombia Government International Bond	8,00 %	20.04.2033	658.786	0,67
279.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp	1,75 %	15.04.2026	247.353	0,25
500.000	Ukraine Government International Bond	0,00 %	01.08.2041	147.400	0,15
156.000	Ukraine Government International Bond	7,75 %	01.09.2027	34.183	0,03
200.000	Ukraine Government International Bond	9,75 %	01.11.2030	41.444	0,04
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>2.075.893</b>	<b>2,11</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>4.401.408</b>	<b>4,48</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>91.384.080</b>	<b>93,02</b>

Devisenterminkontrakte 0,87 % (31. Dezember 2021: 0,35 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht- realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
82.049 CHF	88.577 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	790	0,00
15.459.351 CHF	16.640.232 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	197.891	0,20

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,87 % (31. Dezember 2021: 0,35 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
440.513 €	465.163 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	7.250	0,01
53.036.524 €	56.234.084 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	6	643.069	0,66
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
261.710 US\$	214.140 £	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	3.664	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
1.000 SEK	96 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
28.832 US\$	293.410 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	4	558	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>853.222</b>	<b>0,87</b>

### Futures-Kontrakte 0,05 % (31. Dezember 2021: 0,06 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(35)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	32.812	0,03
(8)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	17.125	0,02
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>49.937</b>	<b>0,05</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>92.287.239</b>	<b>93,94</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,14 %) (31. Dezember 2021: (0,03 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
142.958 US\$	992.936 CNY	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(713)	(0,00)
183.314 US\$	175.137 €	05.01.2023	UBS AG	1	(3.614)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
94.258 US\$	86.648 CHF	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(118)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
9.251.968 US\$	8.743.212 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(124.382)	(0,13)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
240.976 £	294.513 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	3	(4.127)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SEK</i>						
3.229.821 SEK	312.622 US\$	15.03.2023	Goldman Sachs International	4	(1.385)	(0,00)
49 SEK	5 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
1.716 US\$	17.849 SEK	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(5)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(134.345)</b>	<b>(0,14)</b>

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Futures-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))**

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
25	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	(7.617)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(7.617)</b>	<b>(0,01)</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(141.962)</b>	<b>(0,15)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>92.145.277</b>	<b>93,79</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>6.099.031</b>	<b>6,21</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>98.244.308</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	65.629.750	64,89
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	25.754.330	25,46
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	42.320	0,04
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	718.877	0,71
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>92.145.277</b>	<b>91,10</b>

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 4,87 %</b>					
<b>US-Dollar</b>					
750.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC <sup>†</sup>	4,50 %	14.09.2027	740.535	0,47
670.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand**	5,38 %	17.04.2025	664.439	0,42
1.323.000	Banque Ouest Africaine de Developpement <sup>†</sup>	4,70 %	22.10.2031	1.133.145	0,72
583.800	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais <sup>†</sup>	5,33 %	15.02.2028	570.632	0,36
200.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank <sup>†</sup>	4,88 %	23.05.2024	193.050	0,12
2.070.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado <sup>†</sup>	3,83 %	14.09.2061	1.430.189	0,90
1.570.000	Inversiones CMPC SA**	3,00 %	06.04.2031	1.327.023	0,84
980.000	Suzano Austria GmbH <sup>†</sup>	5,00 %	15.01.2030	919.265	0,58
550.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	549.914	0,35
200.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	180.005	0,11
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>7.708.197</b>	<b>4,87</b>
<b>Staatsanleihen 85,91 %</b>					
<b>Euro</b>					
950.000	Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>†</sup>	0,50 %	08.07.2031	712.487	0,45
2.043.000	Benin Government International Bond <sup>†</sup>	4,95 %	22.01.2035	1.594.346	1,01
800.000	Bulgaria Government International Bond <sup>†</sup>	4,13 %	23.09.2029	840.489	0,53
2.309.000	Hungary Government International Bond <sup>†</sup>	1,75 %	05.06.2035	1.627.044	1,03
800.000	Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>	5,25 %	22.03.2030	723.476	0,46
1.550.000	Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>	5,88 %	17.10.2031	1.396.097	0,88
2.488.000	Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>	6,63 %	22.03.2048	1.886.966	1,19
4.185.000	Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>	6,88 %	17.10.2040	3.394.432	2,14
1.480.000	Mexico Government International Bond <sup>†</sup>	2,25 %	12.08.2036	1.125.568	0,71
970.000	Mexico Government International Bond <sup>†</sup>	2,38 %	11.02.2030	909.154	0,57
1.960.000	Mexico Government International Bond <sup>†</sup>	3,38 %	23.02.2031	1.926.687	1,22
3.586.000	Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>	1,25 %	11.03.2033	2.678.217	1,69
1.234.000	Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>	1,95 %	17.11.2036	911.677	0,58
247.000	Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>	3,75 %	01.03.2030	245.563	0,15
2.850.000	Philippine Government International Bond <sup>†</sup>	0,70 %	03.02.2029	2.524.870	1,59
800.000	Philippine Government International Bond <sup>†</sup>	1,20 %	28.04.2033	660.614	0,42
1.860.000	Philippine Government International Bond <sup>†</sup>	1,75 %	28.04.2041	1.370.297	0,86
41.293	Provincia de Buenos Aires <sup>†</sup>	4,00 %	01.09.2037	13.718	0,01
2.180.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	2,00 %	28.01.2032	1.562.655	0,99
1.942.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	2,00 %	14.04.2033	1.335.959	0,84
913.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	2,12 %	16.07.2031	674.983	0,43
93.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	2,63 %	02.12.2040	55.815	0,03
500.000	Romanian Government International Bond**	2,88 %	26.05.2028	463.137	0,29
1.040.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	2,88 %	13.04.2042	626.906	0,40
2.045.000	Romanian Government International Bond <sup>†</sup>	3,38 %	28.01.2050	1.268.234	0,80

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Staatsanleihen 85,91 % (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
3.208.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	2.568.562	1,62
490.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	387.392	0,24
486.000	Romanian Government International Bond*	4,63 %	03.04.2049	380.561	0,24
1.230.000	Serbia International Bond*	1,00 %	23.09.2028	944.134	0,60
3.001.000	Serbia International Bond*	1,50 %	26.06.2029	2.306.056	1,46
400.000	Serbia International Bond*	1,65 %	03.03.2033	260.577	0,16
3.279.000	Serbia International Bond*	2,05 %	23.09.2036	1.987.403	1,25
770.000	Serbia International Bond*	3,13 %	15.05.2027	709.618	0,45
303.000	Ukraine Government International Bond**	6,75 %	20.06.2028	59.962	0,04
<b>Euro insgesamt</b>				<b>40.133.656</b>	<b>25,33</b>
<b>US-Dollar</b>					
1.257.000	Abu Dhabi Government International Bond*	3,00 %	15.09.2051	904.491	0,57
1.500.057	Argentine Republic Government International Bond*	0,50 %	09.07.2030	408.300	0,26
1.906.342	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	510.819	0,32
17.183.136	Argentine Republic Government International Bond*	1,50 %	09.07.2035	4.401.385	2,78
2.422.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	07.01.2041	2.057.305	1,30
2.840.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	21.02.2047	2.259.428	1,43
1.186.000	Brazilian Government International Bond*	8,25 %	20.01.2034	1.336.711	0,84
6.770.000	Chile Government International Bond*	2,55 %	27.07.2033	5.318.633	3,36
1.500.000	Chile Government International Bond*	2,75 %	31.01.2027	1.382.122	0,87
200.000	Chile Government International Bond*	3,50 %	15.04.2053	142.638	0,09
290.000	Chile Government International Bond*	4,34 %	07.03.2042	246.106	0,16
4.773.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	3.664.892	2,31
2.527.000	Colombia Government International Bond*	3,88 %	25.04.2027	2.245.120	1,42
1.626.000	Colombia Government International Bond*	5,00 %	15.06.2045	1.112.275	0,70
1.096.000	Colombia Government International Bond*	5,20 %	15.05.2049	750.580	0,47
1.250.000	Colombia Government International Bond*	8,00 %	20.04.2033	1.255.309	0,79
5.483.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16 %	12.03.2045	5.263.528	3,32
543.000	Dominican Republic International Bond*	5,88 %	30.01.2060	400.334	0,25
400.000	Dominican Republic International Bond*	5,95 %	25.01.2027	392.804	0,25
188.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	19.07.2028	181.891	0,12
3.219.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	22.02.2033	2.915.777	1,84
3.360.000	Dominican Republic International Bond*	6,40 %	05.06.2049	2.728.547	1,72
525.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	457.789	0,29
1.049.121	Ecuador Government International Bond*	0,00 %	31.07.2030	414.987	0,26
410.576	Ecuador Government International Bond*	1,50 %	31.07.2040	169.088	0,11
6.006.673	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2035	2.791.530	1,76
2.268.908	Ecuador Government International Bond*	5,50 %	31.07.2030	1.469.273	0,93



## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 85,91 % (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
248.000	El Salvador Government International Bond*	7,65 %	15.06.2035	101.237	0,06
1.451.000	El Salvador Government International Bond*	8,63 %	28.02.2029	644.465	0,40
1.569.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	701.877	0,44
858.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	4,63 %	12.04.2027	813.701	0,51
910.000	Ghana Government International Bond*	6,38 %	11.02.2027	353.826	0,22
233.000	Ghana Government International Bond*	7,75 %	07.04.2029	87.608	0,06
600.000	Ghana Government International Bond*	8,95 %	26.03.2051	214.878	0,14
3.233.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	2.291.227	1,45
1.492.756	Ivory Coast Government International Bond*	5,75 %	31.12.2032	1.415.588	0,89
670.000	Mexico Government International Bond*	3,50 %	12.02.2034	537.855	0,34
1.438.000	Mexico Government International Bond*	4,88 %	19.05.2033	1.322.876	0,84
3.230.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	2.729.688	1,72
240.000	Morocco Government International Bond*	2,38 %	15.12.2027	209.825	0,13
3.390.000	Morocco Government International Bond*	3,00 %	15.12.2032	2.722.223	1,72
3.090.000	Morocco Government International Bond*	5,50 %	11.12.2042	2.661.566	1,68
2.990.000	Oman Government International Bond*	6,25 %	25.01.2031	3.021.294	1,91
5.032.000	Oman Government International Bond*	6,75 %	17.01.2048	4.733.849	2,99
1.169.000	Panama Government International Bond*	6,40 %	14.02.2035	1.189.352	0,75
640.000	Panama Government International Bond*	6,70 %	26.01.2036	669.341	0,42
81.000	Panama Government International Bond*	8,88 %	30.09.2027	93.447	0,06
5.013.000	Peruvian Government International Bond*	3,00 %	15.01.2034	3.964.800	2,50
750.000	Peruvian Government International Bond*	7,35 %	21.07.2025	788.075	0,50
364.000	Peruvian Government International Bond*	8,75 %	21.11.2033	444.171	0,28
211.000	Philippine Government International Bond*	5,61 %	13.04.2033	223.744	0,14
61.000	Provincia de Mendoza Argentina*	4,25 %	19.03.2029	46.396	0,03
1.640.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60 %	02.02.2031	1.311.984	0,83
4.110.000	Republic of Armenia International Bond*	3,95 %	26.09.2029	3.406.187	2,15
858.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,75 %	16.11.2032	916.570	0,58
800.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	3,70 %	25.11.2030	673.218	0,43
3.870.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	4,75 %	20.02.2024	3.796.741	2,40
805.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	5,38 %	20.02.2029	749.612	0,47
310.000	Romanian Government International Bond*	3,00 %	27.02.2027	275.664	0,17
377.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20 %	11.05.2027	120.293	0,08
1.060.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	339.467	0,21
1.220.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,83 %	18.07.2026	390.713	0,25
248.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	78.993	0,05
1.454.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	03.11.2025	469.050	0,30
491.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55 %	28.03.2030	156.668	0,10
677.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85 %	14.03.2029	216.811	0,14

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 85,91 % (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
590.000	UAE International Government Bond*	4,95 %	07.07.2052	590.570	0,37
884.000	Ukraine Government International Bond*	0,00 %	01.08.2041	260.603	0,16
2.230.000	Ukraine Government International Bond*	6,88 %	21.05.2031	434.850	0,27
270.000	Ukraine Government International Bond*	7,38 %	25.09.2034	51.486	0,03
705.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	154.483	0,10
225.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	49.037	0,03
1.004.000	Ukraine Government International Bond*	9,75 %	01.11.2030	208.049	0,13
2.100.000	Uruguay Government International Bond*	4,38 %	23.01.2031	2.091.139	1,32
770.000	Uruguay Government International Bond*	5,10 %	18.06.2050	757.450	0,48
1.207.741	Uruguay Government International Bond*	5,75 %	28.10.2034	1.308.294	0,83
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>95.972.503</b>	<b>60,58</b>
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>136.106.159</b>	<b>85,91</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>143.814.356</b>	<b>90,78</b>

### Devisenterminkontrakte (0,78 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
91.455.330 €	96.840.714 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	19	1.237.337	0,78
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>1.237.337</b>	<b>0,78</b>

### Futures-Kontrakte 1,59 %

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens	
(31)	Euro-BOBL Future March 2023	132.670	0,09	
(137)	Euro-Bund Future March 2023	1.241.265	0,78	
(43)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	1.135.981	0,72	
147	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	2.297	0,00	
33	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	516	0,00	
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>			<b>2.512.729</b>	<b>1,59</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,03 %

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens	
USD	920.000	20.12.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on CDX.EM.38	53.826	0,03
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b>				<b>53.826</b>	<b>0,03</b>	

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>147.618.248</b>	<b>93,18</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,54 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.922.593 US\$	1.818.757 €	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(18.613)	(0,01)
42.919.290 US\$	40.992.144 €	05.01.2023	Standard Chartered Bank	2	(832.685)	(0,53)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
808.834 €	868.157 US\$	15.03.2023	Westpac Banking Corp	2	(751)	(0,00)
661.377 US\$	620.013 €	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(3.534)	(0,00)
1.171.065 US\$	1.098.029 €	15.03.2023	Westpac Banking Corp	12	(6.475)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(862.058)</b>	<b>(0,54)</b>

### Futures Kontrakte (0,03 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
19	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(5.789)	(0,00)
76	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	(40.641)	(0,03)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>(46.430)</b>	<b>(0,03)</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(908.488)</b>	<b>(0,57)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>146.709.760</b>	<b>92,61</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>11.710.834</b>	<b>7,39</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>158.420.594</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse		US\$	% des Gesamtver- mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	139.999.244	86,30
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	3.244.480	2,00
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	570.632	0,35
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	2.466.299	1,52
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	429.105	0,26
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>146.709.760</b>	<b>90,43</b>

# Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %)</b>			
<b>Australischer Dollar</b>			
3.677	Ampol Ltd*	70.518	0,15
19.366	ANZ Group Holdings Ltd*	310.728	0,65
2.584	Aristocrat Leisure Ltd*	53.481	0,11
40.101	Aurizon Holdings Ltd*	101.435	0,21
2.698	BlueScope Steel Ltd*	30.811	0,06
7.899	Brambles Ltd*	64.656	0,13
15.337	Fortescue Metals Group Ltd*	213.320	0,44
80.863	Telstra Group Ltd*	218.801	0,46
<b>Australischer Dollar insgesamt</b>		<b>1.063.750</b>	<b>2,21</b>
<b>Brasilianischer Real</b>			
50.856	Ambev SA*	138.998	0,29
42.605	Banco Bradesco SA - Preferred Shares*	121.530	0,25
<b>Brasilianischer Real insgesamt</b>		<b>260.528</b>	<b>0,54</b>
<b>Kanadischer Dollar</b>			
1.033	Bank of Montreal*	93.515	0,19
3.959	Bank of Nova Scotia*	193.837	0,40
2.175	Cameco Corp*	49.264	0,10
385	Canadian Imperial Bank of Commerce*	15.563	0,03
563	Canadian National Railway Co*	66.831	0,14
3.536	Enbridge Inc*	138.105	0,29
572	George Weston Ltd**	70.918	0,15
3.271	Gildan Activewear Inc Class A*	89.515	0,19
3.087	Hydro One Ltd**	82.634	0,17
1.856	IGM Financial Inc**	51.778	0,11
8.717	Manulife Financial Corp*	155.368	0,32
1.262	Metro Inc**	69.827	0,15
1.130	Nutrien Ltd*	82.439	0,17
7.975	Pembina Pipeline Corp*	270.513	0,56
5.495	Power Corp of Canada**	129.168	0,27
775	Restaurant Brands International Inc*	50.088	0,11
1.795	TC Energy Corp*	71.511	0,15
1.405	West Fraser Timber Co Ltd*	101.381	0,21
<b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>		<b>1.782.255</b>	<b>3,71</b>
<b>Dänische Krone</b>			
58	AP Moller - Maersk A/S Class B*	129.447	0,27
981	Carlsberg A/S Class B*	129.733	0,27
<b>Dänische Krone insgesamt</b>		<b>259.180</b>	<b>0,54</b>

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Euro</b>			
2.061	Aegon NV*	10.411	0,02
1.297	Amundi SA*	73.332	0,15
5.975	Assicurazioni Generali SpA*	105.933	0,22
991	AXA SA*	27.522	0,06
56.986	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	342.216	0,71
2.523	Bayerische Motoren Werke AG*	222.706	0,46
1.164	Capgemini SE*	194.011	0,41
689	Cie de Saint-Gobain*	33.606	0,07
2.283	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA*	63.408	0,13
8.833	CRH PLC*	350.240	0,73
5.913	Deutsche Post AG*	220.642	0,46
1.388	Eiffage SA*	136.121	0,28
910	Eurazeo SE*	56.485	0,12
481	Eurofins Scientific SE*	34.432	0,07
10.627	Iberdrola SA*	123.683	0,26
1.568	Koninklijke Ahold Delhaize NV*	44.947	0,09
12.372	Koninklijke KPN NV*	38.180	0,08
10.627	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA*	101.810	0,21
2.865	Mercedes-Benz Group AG*	186.797	0,39
1.669	Publicis Groupe SA*	106.301	0,22
2.074	Randstad NV*	126.348	0,26
4.123	Red Electrica Corp SA*	71.477	0,15
2.752	Sanofi*	264.573	0,55
3.985	Societe Generale SA*	99.660	0,21
5.578	STMicroelectronics NV*	197.627	0,41
3.492	Telefonica SA*	12.604	0,03
9.507	TotalEnergies SE*	595.001	1,24
662	UCB SA*	52.005	0,11
566	Wendel SE*	52.711	0,11
976	Wolters Kluwer NV*	101.819	0,21
<b>Euro insgesamt</b>		<b>4.046.608</b>	<b>8,42</b>
<b>Hongkong-Dollar</b>			
25.800	Alibaba Group Holding Ltd*	285.108	0,59
304.000	China Construction Bank Corp - H Shares*	190.464	0,40
30.500	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares*	170.574	0,36
5.000	CK Asset Holdings Ltd*	30.782	0,06
72.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd*	68.449	0,14
338.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares*	174.089	0,36
5.000	Meituan Class B*	111.916	0,23

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong-Dollar (Fortsetzung)</b>			
29.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*	195.219	0,41
38.000	Sino Land Co Ltd*	47.518	0,10
6.100	Tencent Holdings Ltd*	261.040	0,54
20.500	WH Group Ltd*	11.925	0,03
11.000	Wuxi Biologics Cayman Inc*	84.350	0,18
<b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>		<b>1.631.434</b>	<b>3,40</b>
<b>Indonesische Rupiah</b>			
301.631	Bank Central Asia Tbk PT*	165.662	0,35
522.853	Telkom Indonesia Persero Tbk PT*	125.948	0,26
<b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>		<b>291.610</b>	<b>0,61</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
1.900	Asahi Group Holdings Ltd*	59.313	0,12
200	Bridgestone Corp*	7.111	0,01
2.100	Brother Industries Ltd*	31.943	0,07
7.500	Canon Inc*	162.312	0,34
2.300	Dai Nippon Printing Co Ltd*	46.193	0,10
27.200	ENEOS Holdings Inc*	92.354	0,19
1.400	Fuji Electric Co Ltd*	53.371	0,11
14.900	Honda Motor Co Ltd*	342.391	0,71
5.200	KDDI Corp*	156.932	0,33
7.500	Kirin Holdings Co Ltd*	114.309	0,24
5.900	Mitsubishi Electric Corp*	58.734	0,12
3.900	Mitsui OSK Lines Ltd*	97.245	0,20
1.900	Mizuho Financial Group Inc*	26.726	0,06
200	Nippon Express Holdings Inc*	11.429	0,02
6.672	Nippon Telegraph & Telephone Corp*	190.231	0,40
4.800	Nippon Yusen KK*	113.138	0,24
1.000	Nitto Denko Corp*	57.979	0,12
6.000	Sekisui House Ltd*	106.112	0,22
5.400	Sompo Holdings Inc*	239.827	0,50
3.600	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc*	125.179	0,26
1.000	Suntory Beverage & Food Ltd*	34.105	0,07
2.100	Taisei Corp*	67.642	0,14
9.800	Takeda Pharmaceutical Co Ltd*	305.338	0,64
4.100	Tokio Marine Holdings Inc*	87.861	0,18
2.900	TOPPAN INC*	42.947	0,09
2.900	Yamaha Motor Co Ltd*	66.156	0,14
<b>Japanischer Yen insgesamt</b>		<b>2.696.878</b>	<b>5,62</b>

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Mexikanischer Peso</b>			
25.106	Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O*	180.675	0,38
<b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>		<b>180.675</b>	<b>0,38</b>
<b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>			
4.000	ASE Technology Holding Co Ltd*	12.220	0,03
121.650	China Steel Corp*	117.947	0,25
38.492	Chunghwa Telecom Co Ltd*	141.517	0,29
2.624	MediaTek Inc*	53.359	0,11
105.519	Taiwan Cement Corp*	115.525	0,24
23.559	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*	343.779	0,72
9.000	United Microelectronics Corp*	11.918	0,02
<b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>		<b>796.265</b>	<b>1,66</b>
<b>Neuseeländischer Dollar</b>			
18.456	Spark New Zealand Ltd*	63.031	0,13
<b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>		<b>63.031</b>	<b>0,13</b>
<b>Norwegische Krone</b>			
1.316	Yara International ASA*	57.477	0,12
<b>Norwegische Krone insgesamt</b>		<b>57.477</b>	<b>0,12</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
14.247	Anglo American Plc*	555.119	1,16
196.146	Barclays Plc*	371.361	0,77
8.828	Barratt Developments Plc*	41.954	0,09
1.567	Bunzl Plc*	51.874	0,11
946	Ferguson Plc*	118.170	0,24
6.672	GSK Plc*	114.737	0,24
23.682	M&G Plc*	53.283	0,11
44.879	NatWest Group Plc*	142.413	0,30
728	Next Plc*	50.756	0,11
3.219	Persimmon Plc*	46.963	0,10
3.451	Rio Tinto Plc*	241.680	0,50
8.112	Sage Group Plc*	72.681	0,15
6.527	Schroders Plc*	34.124	0,07
4.141	Smiths Group Plc*	79.077	0,16
4.966	SSE Plc*	101.624	0,21
240	Unilever Plc*	12.056	0,03
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>2.087.872</b>	<b>4,35</b>

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Südafrikanischer Rand</b>			
38.600	FirstRand Ltd*	140.042	0,29
11.045	Impala Platinum Holdings Ltd*	138.607	0,29
5.738	Sasol Ltd*	91.443	0,19
<b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>		<b>370.092</b>	<b>0,77</b>
<b>Südkoreanischer Won</b>			
1.219	Hyundai Motor Co*	145.893	0,30
3.756	KB Financial Group Inc*	143.902	0,30
10.110	Samsung Electronics Co Ltd*	443.761	0,92
2.464	SK Hynix Inc*	147.012	0,31
<b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>		<b>880.568</b>	<b>1,83</b>
<b>Schwedische Krone</b>			
2.048	Boliden AB*	77.041	0,16
5.505	Investor AB Class B*	99.793	0,21
1.400	Kinnevik AB Class B*	19.298	0,04
10.811	Nordea Bank Abp*	115.978	0,24
6.214	Skandinaviska Enskilda Banken AB Class A*	71.646	0,15
<b>Schwedische Krone insgesamt</b>		<b>383.756</b>	<b>0,80</b>
<b>Schweizer Franken</b>			
3.564	ABB Ltd*	108.557	0,23
21	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG*	213.864	0,45
1.917	Julius Baer Group Ltd*	111.505	0,23
151	Kuehne + Nagel International AG*	35.084	0,07
2.705	Novartis AG*	244.650	0,51
905	Roche Holding AG*	284.216	0,59
10.167	UBS Group AG*	188.854	0,39
<b>Schweizer Franken insgesamt</b>		<b>1.186.730</b>	<b>2,47</b>
<b>US-Dollar</b>			
1.452	3M Co*	174.124	0,36
3.676	AbbVie Inc*	594.079	1,24
924	Accenture Plc Class A*	246.560	0,51
759	Advance Auto Parts Inc*	111.596	0,23
3.836	Aflac Inc*	275.962	0,57
1.358	Agilent Technologies Inc*	203.225	0,42
127	Allstate Corp*	17.221	0,04
7.352	Alphabet Inc Class A*	648.667	1,35
1.525	Alphabet Inc Class C*	135.313	0,28



## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
2.013	American Express Co*	297.421	0,62
1.590	Ameriprise Financial Inc*	495.078	1,03
1.691	Amgen Inc*	444.124	0,92
7.214	Apple Inc*	937.315	1,95
3.322	Applied Materials Inc*	323.496	0,67
31.009	AT&T Inc*	570.876	1,19
431	Automatic Data Processing Inc*	102.949	0,21
45	AutoZone Inc*	110.978	0,23
2.513	Bank of New York Mellon Corp*	114.392	0,24
417	Becton Dickinson & Co*	106.043	0,22
115	Booking Holdings Inc*	231.757	0,48
6.702	Bristol-Myers Squibb Co*	482.209	1,00
177	Broadcom Inc*	98.966	0,21
3.361	CBRE Group Inc Class A*	258.663	0,54
293	Cheniere Energy Inc*	43.938	0,09
1.538	Chubb Ltd*	339.283	0,71
1.543	Cigna Corp*	511.258	1,06
342	Cintas Corp*	154.454	0,32
8.895	Cisco Systems Inc*	423.758	0,88
10.700	Citigroup Inc*	483.961	1,01
3.989	Citizens Financial Group Inc*	157.047	0,33
3.534	Cognizant Technology Solutions Corp Class A*	202.109	0,42
2.880	Colgate-Palmolive Co*	226.915	0,47
11.105	Comcast Corp Class A*	388.342	0,81
6.644	CSX Corp*	205.831	0,43
1.246	Cummins Inc*	301.893	0,63
5.244	CVS Health Corp*	488.688	1,02
416	Danaher Corp*	110.415	0,23
1.420	Discover Financial Services*	138.919	0,29
2.145	Dow Inc*	108.087	0,23
3.266	Edison International*	207.783	0,43
1.692	Electronic Arts Inc*	206.729	0,43
540	Elevance Health Inc*	277.004	0,58
2.687	Emerson Electric Co*	258.113	0,54
376	Everest Re Group Ltd*	124.558	0,26
1.517	Expeditors International of Washington Inc*	157.647	0,33
3.053	Fidelity National Financial Inc*	114.854	0,24
947	Fortune Brands Innovations Inc*	54.083	0,11
3.246	Fox Corp Class A*	98.581	0,21
5.183	General Mills Inc*	434.595	0,91

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
954	Genuine Parts Co*	165.529	0,34
7.666	Gilead Sciences Inc*	658.126	1,37
1.795	Goldman Sachs Group Inc*	616.367	1,28
1.587	Halliburton Co*	62.448	0,13
2.312	Hartford Financial Services Group Inc*	175.319	0,37
29	HCA Healthcare Inc*	6.959	0,02
1.836	Hologic Inc*	137.351	0,29
1.396	Howmet Aerospace Inc*	55.016	0,11
7.029	HP Inc*	188.869	0,39
1.564	International Business Machines Corp*	220.352	0,46
5.651	Interpublic Group of Cos Inc*	188.235	0,39
1.232	Johnson & Johnson*	217.633	0,46
1.741	JPMorgan Chase & Co*	233.468	0,49
1.529	Kellogg Co*	108.926	0,23
8.804	KeyCorp*	153.366	0,32
638	Keysight Technologies Inc*	109.142	0,23
2.585	Kinder Morgan Inc*	46.737	0,10
1.055	KLA Corp*	397.767	0,83
4.833	Kroger Co*	215.455	0,45
812	Lam Research Corp*	341.284	0,71
1.330	Lennar Corp Class A*	120.365	0,25
2.351	LKQ Corp*	125.567	0,26
339	Lululemon Athletica Inc*	108.609	0,23
2.012	LyondellBasell Industries NV Class A*	167.056	0,35
5.120	Marathon Petroleum Corp*	595.917	1,24
648	Marsh & McLennan Cos Inc*	107.231	0,22
947	Masterbrand Inc*	7.150	0,01
313	Mastercard Inc Class A*	108.839	0,23
408	McDonald's Corp*	107.520	0,22
213	Medtronic Plc*	16.554	0,04
169	MercadoLibre Inc*	143.015	0,30
5.286	Merck & Co Inc*	586.481	1,22
2.158	Microchip Technology Inc*	151.599	0,32
3.047	Microsoft Corp*	730.731	1,52
2.896	Mosaic Co*	127.047	0,26
283	Motorola Solutions Inc*	72.932	0,15
481	NetApp Inc*	28.889	0,06
941	NIKE Inc Class B*	110.106	0,23
8.254	NIO Inc ADR*	80.476	0,17
1.983	Nucor Corp*	261.379	0,54

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,79 % (31. Dezember 2021: 90,16 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
1.260	NXP Semiconductors NV*	199.118	0,41
1.480	ON Semiconductor Corp*	92.308	0,19
7.644	ONEOK Inc*	502.211	1,05
2.001	Owens Corning*	170.685	0,36
677	Parker-Hannifin Corp*	197.007	0,41
607	PepsiCo Inc*	109.661	0,23
6.647	Pfizer Inc*	340.592	0,71
5.007	Phillips 66*	521.128	1,09
3.022	Principal Financial Group Inc*	253.606	0,53
2.251	Procter & Gamble Co*	341.162	0,71
662	Prudential Financial Inc*	65.843	0,14
2.713	QUALCOMM Inc*	298.267	0,62
1.080	Quest Diagnostics Inc*	168.955	0,35
1.026	Robert Half International Inc*	75.750	0,16
389	Snap-on Inc*	88.883	0,19
2.190	Starbucks Corp*	217.248	0,45
1.823	Steel Dynamics Inc*	178.107	0,37
38	Synopsys Inc*	12.133	0,03
1.135	Targa Resources Corp*	83.422	0,17
840	TE Connectivity Ltd*	96.432	0,20
1.537	Tesla Inc*	189.328	0,39
2.625	Texas Instruments Inc*	433.703	0,90
601	Tractor Supply Co*	135.207	0,28
1.296	Travelers Cos Inc*	242.987	0,51
455	Ulta Beauty Inc*	213.427	0,44
283	Union Pacific Corp*	58.601	0,12
1.580	United Parcel Service Inc Class B*	274.667	0,57
803	United Rentals Inc*	285.402	0,59
1.052	UnitedHealth Group Inc*	557.749	1,16
4.767	Valero Energy Corp*	604.742	1,26
3.336	Williams Cos Inc*	109.754	0,23
349	WW Grainger Inc*	194.131	0,40
3.392	Yum China Holdings Inc*	185.373	0,39
866	Yum! Brands Inc*	110.917	0,23
451	Zimmer Biomet Holdings Inc*	57.503	0,12
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>28.921.680</b>	<b>60,23</b>
<b>Aktien insgesamt</b>		<b>46.960.389</b>	<b>97,79</b>

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Immobilienaktiengesellschaften 1,57 % (31. Dezember 2021: 1,67 %)</b>			
<b>Australischer Dollar</b>			
7.956	Dexus	41.814	0,09
37.092	Stockland	91.309	0,19
<b>Australischer Dollar insgesamt</b>		<b>133.123</b>	<b>0,28</b>
<b>Euro</b>			
4.411	Klepierre SA	101.504	0,21
<b>Euro insgesamt</b>		<b>101.504</b>	<b>0,21</b>
<b>Britisches Pfund</b>			
14.532	Land Securities Group Plc	108.028	0,22
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>108.028</b>	<b>0,22</b>
<b>US-Dollar</b>			
7.840	Weyerhaeuser Co	243.040	0,51
2.172	WP Carey Inc	169.742	0,35
<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>412.782</b>	<b>0,86</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>		<b>755.437</b>	<b>1,57</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>47.715.826</b>	<b>99,36</b>

Devisenterminkontrakte 0,26 % (31. Dezember 2021: 0,14 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
40.478 €	41.689 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	1.555	0,00
5.783 €	5.863 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	316	0,00
1.694.668 €	1.687.023 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	30	123.441	0,26
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b>					<b>125.312</b>	<b>0,26</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>47.841.138</b>	<b>99,62</b>

## Systematic Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2021: (0,19 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
5.934 €	6.362 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(23)	(0,00)
3.913 €	4.183 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
23.655 US\$	23.350 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(1.289)	(0,00)
2.634 US\$	2.466 €	18.01.2023	UBS AG	1	(0)	(0,00)
1.233.779 US\$	1.238.307 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	20	(89.141)	(0,19)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(90.456)</b>	<b>(0,19)</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(90.456)</b>	<b>(0,19)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>47.750.682</b>	<b>99,43</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>273.759</b>	<b>0,57</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>48.024.441</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	47.311.501	96,64
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	404.325	0,83
<sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	34.856	0,07
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>47.750.682</b>	<b>97,54</b>

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert % des Netto- EUR vermögens	
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 8,81 % (31. Dezember 2021: 12,59 %)</b>					
<b>Euro</b>					
250.000	Delft BV Series 2020-1 Class B	3,43 %	17.10.2042	245.089	0,03
941.776	Domi BV Series 2020-1 Class A	2,18 %	15.04.2052	931.877	0,11
1.500.000	Domi BV Series 2020-2 Class B	3,26 %	15.11.2052	1.457.308	0,18
4.616.179	Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A	2,28 %	28.04.2059	4.540.386	0,55
2.200.000	Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A	2,23 %	28.03.2057	2.171.708	0,27
1.668.430	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	4,89 %	24.02.2058	1.585.259	0,19
3.117.088	Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A	3,63 %	31.07.2044	3.123.354	0,38
7.032.137	Gedesco Trade Receivables Designated Activity Co Series 2020-1 Class A	3,15 %	24.01.2026	7.037.355	0,86
3.430.532	Jubilee Place Retail Unit Trust LP Series 3 Class A	2,23 %	17.01.2059	3.371.228	0,41
18.392.896	MIRAVET Sarl Series 2019-1 Class A	2,66 %	26.05.2065	18.333.689	2,23
6.593.705	Mulcair Securities No. 3 DAC Series 3 Class A	2,45 %	24.04.2065	6.515.095	0,79
1.250.000	Mulcair Securities No. 3 DAC Series 3 Class D	3,50 %	25.04.2065	1.163.597	0,14
403.938	Primrose Residential Series 2021-1 Class A	2,75 %	24.03.2061	395.344	0,05
1.500.000	Primrose Residential Series 2021-1 Class B	3,35 %	24.03.2061	1.463.233	0,18
6.206.730	Primrose Residential Series 2022-1 Class A	3,00 %	24.10.2061	6.077.077	0,74
3.500.000	Primrose Residential Series 2022-1 Class D	4,40 %	24.10.2061	3.265.563	0,40
1.066.632	Retiro Mortgage Securities Series 1X Class A1	3,58 %	30.07.2075	1.062.693	0,13
262.247	Sabadell Consumo FDT Series 2 Class D	6,89 %	24.12.2034	262.199	0,03
2.518.343	Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class A	2,85 %	24.01.2061	2.458.898	0,30
1.300.000	Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class C	3,90 %	24.01.2061	1.251.653	0,15
1.314.225	Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 2019 Class A1	3,50 %	12.05.2025	1.312.437	0,16
3.000.000	Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 3 Class C	5,69 %	23.06.2039	2.890.017	0,35
1.504.749	Warrington Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class A1	3,89 %	24.12.2056	1.428.902	0,18
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>				<b>72.343.961</b>	<b>8,81</b>
<b>Unternehmensanleihen 81,63 % (31. Dezember 2021: 71,41 %)</b>					
<b>Euro</b>					
2.000.000	AbbVie Inc*	1,25 %	01.06.2024	1.943.674	0,24
4.000.000	AbbVie Inc*	1,50 %	15.11.2023	3.951.175	0,48
1.500.000	Accor SA*	2,63 %	29.12.2049	1.244.902	0,15
2.000.000	Afflelou SAS*	4,25 %	19.05.2026	1.789.200	0,22
5.000.000	ALD SA*	1,25 %	02.03.2026	4.572.884	0,56
2.600.000	Allianz SE*	2,60 %	29.12.2049	1.840.371	0,22
3.000.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	2.720.370	0,33
2.000.000	Altice France SA*	3,38 %	15.01.2028	1.513.900	0,18
1.000.000	Altice France SA*	5,88 %	01.02.2027	876.093	0,11
12.000.000	AMCO - Asset Management Co SpA**	1,38 %	27.01.2025	11.333.940	1,38
1.500.000	American Tower Corp*	0,40 %	15.02.2027	1.283.544	0,16
700.000	American Tower Corp*	1,95 %	22.05.2026	648.993	0,08
2.200.000	ArcelorMittal SA*	4,88 %	26.09.2026	2.203.942	0,27

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,63 % (31. Dezember 2021: 71,41 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Euro (Fortsetzung)</b>				
2.000.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	2,00 %	01.09.2028	1.620.000 0,20
3.000.000	Arena Luxembourg Finance Sarl*	1,88 %	01.02.2028	2.403.390 0,29
1.700.000	Arkema SA*	1,50 %	29.12.2049	1.440.685 0,18
5.000.000	Aroundtown SA*	0,38 %	15.04.2027	3.316.521 0,40
400.000	Aroundtown SA*	2,13 %	29.12.2049	149.550 0,02
4.900.000	Aroundtown SA*	3,38 %	29.12.2049	2.380.346 0,29
3.800.000	Arval Service Lease SA*	3,38 %	04.01.2026	3.723.863 0,45
1.200.000	Arval Service Lease SA*	4,75 %	22.05.2027	1.218.170 0,15
2.400.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	2.055.972 0,25
10.900.000	Athene Global Funding*	0,37 %	10.09.2026	9.226.436 1,12
9.000.000	Athene Global Funding*	0,83 %	08.01.2027	7.666.731 0,93
5.000.000	Athene Global Funding*	1,24 %	08.04.2024	4.798.365 0,58
2.400.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	1.976.520 0,24
6.400.000	Autostrade per l'Italia SpA*	2,00 %	04.12.2028	5.285.484 0,64
3.000.000	Autostrade per l'Italia SpA*	5,88 %	09.06.2024	3.073.393 0,37
2.400.000	Balder Finland OYJ*	1,00 %	18.01.2027	1.796.063 0,22
1.700.000	Banco de Sabadell SA*	2,63 %	24.03.2026	1.599.515 0,19
3.700.000	Banco Santander SA*	0,10 %	26.01.2025	3.570.663 0,43
1.800.000	Banijay Entertainment SASU**	3,50 %	01.03.2025	1.700.235 0,21
2.000.000	Bank of America Corp*	1,78 %	04.05.2027	1.846.068 0,22
4.700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,01 %	07.03.2025	4.350.569 0,53
1.500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,01 %	11.05.2026	1.326.559 0,16
6.510.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,96 %	29.12.2049	5.050.067 0,61
11.800.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	2,74 %	29.12.2049	9.174.500 1,12
3.600.000	Barclays Bank Plc*	2,76 %	29.12.2049	2.594.232 0,32
6.000.000	Barclays Plc*	0,75 %	09.06.2025	5.699.050 0,69
2.700.000	Barclays Plc*	2,89 %	31.01.2027	2.560.043 0,31
8.000.000	Barclays Plc*	3,38 %	02.04.2025	7.925.662 0,96
5.300.000	Bayer AG*	0,05 %	12.01.2025	4.944.063 0,60
2.000.000	Bayer Capital Corp BV*	1,50 %	26.06.2026	1.858.788 0,23
1.850.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	1.557.238 0,19
10.500.000	BNP Paribas SA*	0,25 %	13.04.2027	9.176.822 1,12
750.000	Booking Holdings Inc*	0,10 %	08.03.2025	694.400 0,08
2.250.000	Booking Holdings Inc*	2,38 %	23.09.2024	2.208.100 0,27
4.000.000	BPCE SA*	0,38 %	02.02.2026	3.620.425 0,44
4.000.000	BPCE SA*	0,63 %	28.04.2025	3.737.920 0,45
2.600.000	BPCE SA*	1,00 %	15.07.2024	2.513.628 0,31
5.000.000	Capital One Financial Corp*	0,80 %	12.06.2024	4.764.323 0,58
2.000.000	Celanese US Holdings LLC*	2,13 %	01.03.2027	1.704.734 0,21
800.000	Cellnex Telecom SA*	1,75 %	23.10.2030	622.546 0,08

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,63 % (31. Dezember 2021: 71,41 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Euro (Fortsetzung)</b>				
1.700.000	Cirsa Finance International Sarl <sup>+</sup>	4,50 %	15.03.2027	1.473.329 0,18
8.000.000	Citigroup Inc <sup>+</sup>	1,25 %	06.07.2026	7.465.736 0,91
5.700.000	Citigroup Inc <sup>+</sup>	1,50 %	24.07.2026	5.340.689 0,65
4.000.000	CK Hutchison Finance 16 II Ltd <sup>+</sup>	0,88 %	03.10.2024	3.785.752 0,46
10.035.000	CK Hutchison Finance 16 Ltd <sup>+</sup>	1,25 %	06.04.2023	9.996.014 1,22
2.000.000	CNH Industrial Finance Europe SA <sup>+</sup>	2,88 %	17.05.2023	1.998.842 0,24
8.284.000	Commerzbank AG <sup>+</sup>	0,10 %	11.09.2025	7.537.960 0,92
1.000.000	Commerzbank AG <sup>+</sup>	1,25 %	23.10.2023	984.355 0,12
700.000	Commonwealth Bank of Australia <sup>+</sup>	3,25 %	24.10.2025	695.691 0,08
1.000.000	Credit Agricole SA <sup>+</sup>	1,00 %	22.04.2026	932.992 0,11
6.600.000	Credit Suisse AG <sup>+</sup>	0,25 %	05.01.2026	5.616.838 0,68
2.000.000	Credit Suisse AG <sup>+</sup>	1,50 %	10.04.2026	1.738.798 0,21
2.000.000	Credit Suisse AG <sup>+</sup>	2,13 %	31.05.2024	1.902.738 0,23
2.500.000	Credit Suisse Group AG <sup>+</sup>	0,65 %	14.01.2028	1.873.669 0,23
8.300.000	Credit Suisse Group AG <sup>+</sup>	1,25 %	17.07.2025	7.461.476 0,91
1.100.000	Credit Suisse Group AG <sup>+</sup>	2,13 %	13.10.2026	937.648 0,11
2.200.000	Credit Suisse Group AG <sup>+</sup>	3,25 %	02.04.2026	1.979.358 0,24
100.000	Cullinan Holdco Scsp <sup>**</sup>	4,63 %	15.10.2026	87.921 0,01
5.000.000	Danone SA <sup>+</sup>	1,75 %	29.12.2049	4.943.010 0,60
10.000.000	Danske Bank A/S <sup>+</sup>	0,01 %	10.11.2024	9.685.860 1,18
1.500.000	Danske Bank A/S <sup>+</sup>	1,38 %	17.02.2027	1.366.172 0,17
7.000.000	Deutsche Bank AG <sup>+</sup>	1,00 %	19.11.2025	6.541.128 0,80
500.000	Deutsche Lufthansa AG <sup>+</sup>	3,50 %	14.07.2029	426.502 0,05
3.338.000	Deutsche Postbank Funding Trust III <sup>+</sup>	2,08 %	29.12.2049	2.412.045 0,29
4.000.000	Digital Euro Finco LLC <sup>+</sup>	2,50 %	16.01.2026	3.712.148 0,45
4.906.000	Digital Euro Finco LLC <sup>+</sup>	2,63 %	15.04.2024	4.765.831 0,58
1.300.000	doValue SpA <sup>+</sup>	3,38 %	31.07.2026	1.152.080 0,14
500.000	doValue SpA <sup>**</sup>	5,00 %	04.08.2025	483.100 0,06
1.800.000	Dufry One BV <sup>+</sup>	3,38 %	15.04.2028	1.497.826 0,18
4.500.000	easyJet FinCo BV <sup>+</sup>	1,88 %	03.03.2028	3.640.005 0,44
1.200.000	Electricite de France SA <sup>+</sup>	2,88 %	29.12.2049	987.046 0,12
3.500.000	Electricite de France SA <sup>+</sup>	4,00 %	29.12.2049	3.290.227 0,40
1.750.000	Emeria SASU <sup>**</sup>	3,38 %	31.03.2028	1.463.525 0,18
800.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG <sup>+</sup>	1,38 %	31.08.2081	594.494 0,07
1.500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG <sup>+</sup>	1,88 %	29.06.2080	1.293.457 0,16
2.200.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG <sup>+</sup>	2,13 %	31.08.2081	1.484.947 0,18
900.000	EnBW International Finance BV <sup>+</sup>	3,63 %	22.11.2026	902.018 0,11
2.000.000	Enel Finance International NV <sup>+</sup>	0,00 %	28.05.2026	1.766.706 0,21
2.000.000	Enel SpA <sup>+</sup>	1,38 %	29.12.2049	1.587.420 0,19
3.250.000	Enel SpA <sup>+</sup>	2,50 %	29.12.2049	3.179.247 0,39



## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- vermögens EUR	Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,63 % (31. Dezember 2021: 71,41 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
1.000.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50 %	30.06.2029	803.570	0,10
2.000.000	Eni SpA*	3,38 %	29.12.2049	1.665.960	0,20
4.983.000	European Union*	1,25 %	04.02.2043	3.511.176	0,43
3.127.000	European Union*	2,75 %	04.12.2037	2.911.087	0,35
1.400.000	Evonik Industries AG*	1,38 %	02.09.2081	1.145.830	0,14
1.000.000	Fastighets AB Balder*	1,13 %	29.01.2027	744.645	0,09
4.000.000	Fastighets AB Balder*	1,88 %	14.03.2025	3.395.400	0,41
2.000.000	Faurecia SE*	2,63 %	15.06.2025	1.826.250	0,22
4.000.000	Faurecia SE*	2,75 %	15.02.2027	3.389.588	0,41
1.300.000	FCA Bank SpA*	0,00 %	16.04.2024	1.238.489	0,15
2.000.000	FCA Bank SpA*	0,13 %	16.11.2023	1.941.646	0,24
17.100.000	Goldman Sachs Group Inc*	1,38 %	15.05.2024	16.749.125	2,04
1.400.000	Goldman Sachs Group Inc*	4,00 %	21.09.2029	1.361.777	0,17
500.000	Grand City Properties SA*	2,50 %	29.12.2049	226.974	0,03
1.200.000	Gruenthal GmbH*	3,63 %	15.11.2026	1.102.356	0,13
1.000.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50 %	30.04.2028	711.944	0,09
1.100.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV*	1,25 %	29.03.2026	1.016.600	0,12
2.000.000	Heathrow Funding Ltd*	1,50 %	12.10.2025	1.861.764	0,23
11.282.000	Heimstaden Bostad AB*	2,13 %	05.09.2023	10.987.698	1,34
1.300.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,25 %	13.10.2024	1.152.106	0,14
5.300.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,63 %	24.07.2025	4.499.981	0,55
8.500.000	Holcim Finance Luxembourg SA*	1,50 %	06.04.2025	8.074.403	0,98
406.000	Holcim Finance Luxembourg SA*	3,00 %	29.12.2049	391.863	0,05
2.500.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	2.324.545	0,28
2.000.000	INEOS Finance Plc*	2,88 %	01.05.2026	1.729.980	0,21
2.500.000	ING Groep NV*	0,13 %	29.11.2025	2.317.897	0,28
2.000.000	ING Groep NV*	2,13 %	23.05.2026	1.905.572	0,23
2.700.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	2.085.750	0,25
3.675.000	Intesa Sanpaolo SpA**	1,00 %	04.07.2024	3.536.155	0,43
1.625.000	Intesa Sanpaolo SpA*	1,63 %	21.04.2025	1.534.783	0,19
14.495.000	Intesa Sanpaolo SpA**	2,13 %	26.05.2025	13.901.662	1,69
1.500.000	Intesa Sanpaolo SpA*	2,93 %	14.10.2030	1.196.593	0,15
1.700.000	Intesa Sanpaolo SpA*	4,75 %	06.09.2027	1.713.290	0,21
6.100.000	Investec Bank Plc*	1,25 %	11.08.2026	5.464.209	0,67
1.700.000	IPD 3 BV*	5,50 %	01.12.2025	1.617.890	0,20
5.000.000	Islandsbanki HF*	0,75 %	25.03.2025	4.310.995	0,52
3.200.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	2.438.352	0,30
1.800.000	Johnson Controls International Plc/Tyco Fire & Security Finance SCA*	3,00 %	15.09.2028	1.707.007	0,21
200.000	Kleopatra Finco Sarl**	4,25 %	01.03.2026	156.780	0,02
2.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.06.2026	2.172.091	0,26

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,63 % (31. Dezember 2021: 71,41 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Euro (Fortsetzung)</b>				
2.000.000	Landsbankinn HF*	0,38 %	23.05.2025	1.710.477 0,21
2.500.000	Landsbankinn HF*	0,50 %	20.05.2024	2.299.512 0,28
12.000.000	Landsbankinn HF*	0,75 %	25.05.2026	9.653.845 1,18
3.000.000	LeasePlan Corp NV*	0,25 %	23.02.2026	2.611.677 0,32
1.700.000	LeasePlan Corp NV*	0,25 %	07.09.2026	1.458.546 0,18
6.000.000	Lloyds Banking Group Plc*	0,50 %	12.11.2025	5.611.524 0,68
7.000.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,50 %	01.04.2026	6.891.507 0,84
1.400.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	1.258.250 0,15
2.000.000	Loxam SAS*	4,50 %	15.04.2027	1.688.778 0,21
1.280.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	898.074 0,11
2.000.000	Mercedes-Benz International Finance BV*	0,88 %	09.04.2024	1.942.619 0,24
2.200.000	Merck KGaA*	1,63 %	25.06.2079	2.079.977 0,25
3.700.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc*	3,27 %	19.09.2025	3.644.149 0,44
1.500.000	MMS USA Holdings Inc*	0,63 %	13.06.2025	1.390.019 0,17
5.000.000	Molson Coors Beverage Co*	1,25 %	15.07.2024	4.833.785 0,59
11.500.000	Morgan Stanley*	1,88 %	27.04.2027	10.493.900 1,28
3.000.000	Mylan Inc*	2,13 %	23.05.2025	2.853.526 0,35
3.000.000	National Australia Bank Ltd*	2,35 %	30.08.2029	2.797.320 0,34
1.200.000	Nationwide Building Society*	3,25 %	05.09.2029	1.131.551 0,14
5.000.000	NatWest Group Plc*	1,75 %	02.03.2026	4.708.962 0,57
5.000.000	NatWest Markets Plc*	0,13 %	12.11.2025	4.481.745 0,55
2.000.000	NatWest Markets Plc*	0,13 %	18.06.2026	1.747.036 0,21
2.700.000	NatWest Markets Plc*	2,00 %	27.08.2025	2.568.861 0,31
2.000.000	NGG Finance Plc*	1,63 %	05.12.2079	1.866.916 0,23
1.500.000	Nordea Bank Abp*	1,00 %	27.06.2029	1.404.832 0,17
900.000	Ontex Group NV*	3,50 %	15.07.2026	764.592 0,09
2.000.000	Orano SA*	3,38 %	23.04.2026	1.952.964 0,24
1.500.000	Paprec Holding SA*	4,00 %	31.03.2025	1.454.940 0,18
500.000	PCF GmbH*	4,75 %	15.04.2026	416.314 0,05
2.167.000	Petroleos Mexicanos*	4,75 %	26.02.2029	1.696.542 0,21
1.600.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50 %	15.02.2025	1.407.000 0,17
1.800.000	Playtech Plc*	4,25 %	07.03.2026	1.705.475 0,21
500.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63 %	05.01.2026	472.270 0,06
2.100.000	Prosus NV*	2,78 %	19.01.2034	1.517.233 0,18
3.300.000	PVH Corp**	3,13 %	15.12.2027	3.020.927 0,37
4.000.000	RCI Banque SA*	0,50 %	15.09.2023	3.933.268 0,48
2.300.000	RCI Banque SA*	0,50 %	14.07.2025	2.096.012 0,26
3.000.000	RCI Banque SA*	1,63 %	11.04.2025	2.835.339 0,35
1.500.000	RCI Banque SA*	1,75 %	10.04.2026	1.375.170 0,17
3.000.000	RCI Banque SA*	2,00 %	11.07.2024	2.921.630 0,36

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens
<b>Unternehmensanleihen 81,63 % (31. Dezember 2021: 71,41 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Euro (Fortsetzung)</b>				
3.000.000	Repsol International Finance BV <sup>*</sup>	2,50 %	29.12.2049	2.588.464 0,32
4.000.000	Ryanair DAC <sup>*</sup>	0,88 %	25.05.2026	3.585.140 0,44
2.200.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB <sup>*</sup>	1,00 %	12.08.2027	1.538.493 0,19
3.380.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB <sup>*</sup>	2,63 %	29.12.2049	1.327.843 0,16
1.000.000	Santander Consumer Finance SA <sup>*</sup>	0,38 %	17.01.2025	936.758 0,11
5.000.000	Santander UK Group Holdings Plc <sup>*</sup>	0,39 %	28.02.2025	4.775.564 0,58
2.000.000	Sappi Papier Holding GmbH <sup>*</sup>	3,63 %	15.03.2028	1.725.000 0,21
2.000.000	Scania CV AB <sup>*</sup>	0,50 %	06.10.2023	1.953.172 0,24
1.900.000	SELP Finance Sarl <sup>*</sup>	3,75 %	10.08.2027	1.770.685 0,22
1.000.000	Simon International Finance SCA <sup>*</sup>	1,25 %	13.05.2025	1.007.210 0,12
5.000.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC <sup>*</sup>	2,88 %	15.01.2026	4.855.359 0,59
3.000.000	Societe Generale SA <sup>*</sup>	1,25 %	15.02.2024	2.929.140 0,36
2.000.000	SoftBank Group Corp <sup>*</sup>	2,13 %	06.07.2024	1.886.556 0,23
1.800.000	SoftBank Group Corp <sup>*</sup>	5,00 %	15.04.2028	1.535.371 0,19
4.640.000	Southern Co <sup>*</sup>	1,88 %	15.09.2081	3.642.377 0,44
1.500.000	Spectrum Brands Inc <sup>*</sup>	4,00 %	01.10.2026	1.415.625 0,17
1.000.000	Stellantis NV <sup>*</sup>	3,75 %	29.03.2024	999.936 0,12
541.000	Stellantis NV <sup>*</sup>	4,50 %	07.07.2028	542.684 0,07
2.000.000	Stryker Corp <sup>*</sup>	0,25 %	03.12.2024	1.881.938 0,23
710.000	Summit Properties Ltd <sup>*</sup>	2,00 %	31.01.2025	614.029 0,07
6.250.000	Sysco Corp <sup>*</sup>	1,25 %	23.06.2023	6.201.912 0,76
1.500.000	Telefonica Europe BV <sup>*</sup>	2,38 %	29.12.2049	1.128.600 0,14
200.000	Tereos Finance Groupe I SA <sup>**</sup>	4,75 %	30.04.2027	182.140 0,02
1.800.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup>	1,63 %	15.10.2028	1.342.458 0,16
1.240.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup>	6,00 %	31.01.2025	1.224.994 0,15
2.000.000	Thames Water Utilities Finance Plc <sup>*</sup>	0,19 %	23.10.2023	1.957.357 0,24
3.400.000	Toronto-Dominion Bank <sup>*</sup>	2,55 %	03.08.2027	3.183.182 0,39
3.800.000	TotalEnergies SE <sup>*</sup>	2,00 %	29.12.2049	3.256.414 0,40
4.000.000	TotalEnergies SE <sup>*</sup>	2,71 %	29.12.2049	3.965.768 0,48
5.000.000	UBS Group AG <sup>*</sup>	0,25 %	29.01.2026	4.589.765 0,56
3.000.000	UBS Group AG <sup>*</sup>	0,25 %	03.11.2026	2.671.191 0,33
2.500.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE <sup>*</sup>	2,13 %	29.12.2049	2.149.600 0,26
5.000.000	UniCredit SpA <sup>**</sup>	0,33 %	19.01.2026	4.453.118 0,54
3.500.000	UniCredit SpA <sup>**</sup>	1,20 %	20.01.2026	3.245.572 0,40
5.896.000	UniCredit SpA <sup>**</sup>	2,20 %	22.07.2027	5.350.343 0,65
2.200.000	UniCredit SpA <sup>**</sup>	5,85 %	15.11.2027	2.235.873 0,27
1.700.000	United Group BV <sup>**</sup>	3,13 %	15.02.2026	1.371.475 0,17
1.600.000	United Group BV <sup>**</sup>	5,25 %	01.02.2030	1.158.792 0,14
15.000.000	Utah Acquisition Sub Inc <sup>*</sup>	2,25 %	22.11.2024	14.495.145 1,76
2.900.000	Veolia Environnement SA <sup>*</sup>	2,50 %	29.12.2049	2.319.797 0,28

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- EUR vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 81,63 % (31. Dezember 2021: 71,41 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
1.600.000	Virgin Money UK Plc <sup>*</sup>	2,88 %	24.06.2025	1.534.145	0,19
4.500.000	Vivion Investments Sarl <sup>*</sup>	3,00 %	08.08.2024	3.519.234	0,43
2.600.000	Vodafone Group Plc <sup>*</sup>	3,00 %	27.08.2080	2.081.612	0,25
4.800.000	Volkswagen Bank GmbH <sup>*</sup>	2,50 %	31.07.2026	4.485.136	0,54
4.000.000	Volkswagen Financial Services AG <sup>*</sup>	0,00 %	12.02.2025	3.675.708	0,45
3.200.000	Volkswagen Financial Services AG <sup>*</sup>	0,25 %	31.01.2025	2.970.358	0,36
5.000.000	Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup>	3,75 %	29.12.2049	4.264.374	0,52
1.800.000	Vonovia SE <sup>*</sup>	1,38 %	28.01.2026	1.635.516	0,20
4.000.000	Vonovia SE <sup>*</sup>	4,75 %	23.05.2027	3.957.744	0,48
2.000.000	VZ Vendor Financing II BV <sup>*</sup>	2,88 %	15.01.2029	1.547.168	0,19
9.000.000	Wizz Air Finance Co BV <sup>*</sup>	1,00 %	19.01.2026	7.471.557	0,91
1.000.000	Wizz Air Finance Co BV <sup>*</sup>	1,35 %	19.01.2024	951.589	0,12
1.000.000	ZF Finance GmbH <sup>*</sup>	2,00 %	06.05.2027	821.172	0,10
1.700.000	ZF Finance GmbH <sup>*</sup>	2,25 %	03.05.2028	1.333.767	0,16
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>670.503.994</b>	<b>81,63</b>
<b>Staatsanleihen 6,87 % (31. Dezember 2021: 5,38 %)</b>					
<b>Euro</b>					
5.340.000	Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>	3,00 %	30.05.2029	4.834.152	0,58
3.400.000	Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>	4,00 %	08.09.2027	3.332.194	0,41
700.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe <sup>*</sup>	2,10 %	15.11.2029	683.528	0,08
3.500.000	Croatia Government International Bond <sup>*</sup>	2,88 %	22.04.2032	3.228.655	0,39
2.551.416	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond <sup>*</sup>	0,10 %	15.04.2026	2.532.288	0,31
470.000	Estonia Government International Bond <sup>*</sup>	4,00 %	12.10.2032	482.550	0,06
3.830.000	French Republic Government Bond OAT <sup>*</sup>	0,75 %	25.02.2028	3.455.897	0,42
2.160.000	French Republic Government Bond OAT <sup>*</sup>	2,00 %	25.11.2032	1.971.227	0,24
2.968.000	Hellenic Republic Government Bond <sup>*</sup>	1,75 %	18.06.2032	2.343.881	0,29
4.720.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>*</sup>	0,25 %	15.03.2028	3.901.977	0,47
3.634.855	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	0,50 %	20.04.2023	3.623.223	0,44
6.621.835	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	1,30 %	15.05.2028	6.416.558	0,78
2.789.235	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	1,40 %	26.05.2025	2.758.375	0,34
3.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	1,75 %	30.05.2024	2.938.248	0,36
2.557.020	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro <sup>**</sup>	3,10 %	15.09.2026	2.716.586	0,33
750.000	Italy Government International Bond <sup>*</sup>	5,13 %	31.07.2024	768.871	0,09
1.000.000	Lithuania Government International Bond <sup>*</sup>	2,13 %	01.06.2032	875.034	0,11
3.670.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT <sup>*</sup>	1,95 %	15.06.2029	3.428.813	0,42
2.147.000	Romanian Government International Bond <sup>*</sup>	1,75 %	13.07.2030	1.498.698	0,18
2.800.000	Romanian Government International Bond <sup>*</sup>	2,00 %	28.01.2032	1.878.405	0,23
1.300.000	Romanian Government International Bond <sup>*</sup>	3,62 %	26.05.2030	1.067.208	0,13

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 6,87 % (31. Dezember 2021: 5,38 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Euro (Fortsetzung)</b>					
2.314.000	Romanian Government International Bond <sup>*</sup>	3,88 %	29.10.2035	1.713.745	0,21
<b>Staatsanleihen insgesamt</b>				<b>56.450.113</b>	<b>6,87</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>799.298.068</b>	<b>97,31</b>

Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2021: 0,10 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
32.431 CHF	32.795 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	68	0,00
39.279 €	38.562 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	203	0,00
457.861 €	451.138 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	710	0,00
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
456.683 €	484.263 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	3.393	0,00
3.827.283 €	3.845.504 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	227.734	0,03
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>™</sup></b>					<b>232.108</b>	<b>0,03</b>

Futures-Kontrakte 1,14 % (31. Dezember 2021: 0,30 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
(758)	Euro-BOBL Future March 2023	3.139.258	0,38
(96)	Euro-BTP Future March 2023	215.230	0,03
(122)	Euro-Bund Future March 2023	991.243	0,12
230	Euro-Bund Put Option on Future February 2023, Strike Price EUR 136	628.725	0,07
(103)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	2.640.125	0,32
(61)	Euro-OAT Future March 2023	551.920	0,07
(883)	Euro-Schatz Future March 2023	1.236.200	0,15
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>9.402.701</b>	<b>1,14</b>

Inflation-Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,05 %)

Nominalwert	Fällig- keit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
EUR 25.000.000	23.09.2025	LCH Clearent Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	3,58 %	CPTFEMU	9.296	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten<sup>*</sup></b>						<b>9.296</b>	<b>0,00</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>808.942.173</b>	<b>98,48</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,80 %) (31. Dezember 2021: (0,02 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
80.254 CHF	82.112 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(788)	(0,00)
7.600.803 CHF	7.834.258 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	(132.134)	(0,02)
113 €	111 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen USD</i>						
1.023.664 US\$	1.001.735 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(43.544)	(0,00)
92.163.713 US\$	92.663.270 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	(6.394.315)	(0,78)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(6.570.781)</b>	<b>(0,80)</b>

### Futures-Kontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
365	3-Month Euro EURIBOR Future December 2023	(1.710.938)	(0,21)
1	Euro-BTP Future March 2023	(8.170)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(1.719.108)</b>	<b>(0,21)</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2021: (0,34 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
EUR 50.000.000	20/12/20027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover S38	(543.950)	(0,07)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b>				<b>(543.950)</b>	<b>(0,07)</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
EUR 50.000.000	16.09.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,27 %	1D EUROSTR	(761.699)	(0,09)
EUR 12.479.054	30.08.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,22 %	6M EURIBOR	(974.289)	(0,12)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>(1.735.988)</b>	<b>(0,21)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert	% des Netto-
	EUR	vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(10.569.827)</b>	<b>(1,29)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>798.372.346</b>	<b>97,19</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>23.017.721</b>	<b>2,81</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>821.390.067</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	EUR	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	643.987.520	77,27
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	155.310.548	18,63
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	7.683.593	0,92
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(8.609.315)	(1,03)
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>798.372.346</b>	<b>95,79</b>

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 4,32 % (31. Dezember 2021: 0,64 %)</b>			
<b>Euro</b>			
80.000	Epic Acquisition Corp	849.531	0,03
52.998	European Healthcare Acquisition & Growth Co BV	562.793	0,02
50.000	Spear Investments I BV	538.961	0,02
	<b>Euro insgesamt</b>	<b>1.951.285</b>	<b>0,07</b>
<b>Japanischer Yen</b>			
15.800	Socionext Inc	694.532	0,02
	<b>Japanischer Yen insgesamt</b>	<b>694.532</b>	<b>0,02</b>
<b>US-Dollar</b>			
7.007	Advanced Micro Devices Inc	453.843	0,01
3.581	AECOM	304.134	0,01
3.922	AeroVironment Inc	335.959	0,01
263.200	American Airlines Group Inc	3.347.904	0,11
4.000	AmerisourceBergen Corp Class A	662.840	0,02
1.875	Amgen Inc	492.450	0,02
11.109	AT&T Inc	204.517	0,01
1.754	Broadcom Inc	980.714	0,03
134.848	Carnival Corp	1.086.875	0,03
28.447	Centene Corp	2.332.938	0,07
111.438	Ceridian HCM Holding Inc	7.148.748	0,23
2.000	Charles Schwab Corp	166.520	0,01
5.609	Cigna Corp	1.858.486	0,06
26.542	Cisco Systems Inc	1.264.461	0,04
32.520	Cleveland-Cliffs Inc	523.897	0,02
8.587	Confluent Inc Class A	190.975	0,01
12.092	CONMED Corp	1.071.835	0,03
1.774	Devon Energy Corp	109.119	0,00
15.294	DISH Network Corp Class A	214.728	0,01
2.296	Dollar General Corp	565.390	0,02
5.886	Dollar Tree Inc	832.516	0,03
10.639	Eastman Chemical Co	866.440	0,03
12.496	Edison International	794.996	0,03
200	Elevance Health Inc	102.594	0,00
20.555	Envestnet Inc	1.268.243	0,04
12.714	First Solar Inc	1.904.430	0,06
35.148	FirstEnergy Corp	1.474.107	0,05
13.570	Fluor Corp	470.336	0,01
3.091	FTI Consulting Inc	490.851	0,02
36.100	Gen Digital Inc	773.623	0,02



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 4,32 % (31. Dezember 2021: 0,64 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
6.162	General Mills Inc	516.684	0,02
1.789	Goldman Sachs Group Inc	614.307	0,02
18.465	H&R Block Inc	674.157	0,02
40	Halozyme Therapeutics Inc	2.276	0,00
1.300	HCA Healthcare Inc	311.948	0,01
193.364	Herbalife Nutrition Ltd	2.877.256	0,09
6.215	Hess Corp	881.411	0,03
49.136	Insulet Corp	14.465.147	0,46
2.865	Interpublic Group of Cos Inc	95.433	0,00
41.704	iQIYI Inc ADR	221.031	0,01
3.380	ITT Inc	274.118	0,01
773	JM Smucker Co	122.490	0,00
14.454	Kellogg Co	1.029.703	0,03
243.935	KeyCorp	4.249.348	0,14
1.085	Lithia Motors Inc Class A	222.143	0,01
131.802	Lumen Technologies Inc	688.006	0,02
157.642	Lyft Inc Class A	1.737.215	0,06
9.152	LyondellBasell Industries NV Class A	759.891	0,02
3.132	M&T Bank Corp	454.328	0,01
17.699	Marathon Oil Corp	479.112	0,02
31.320	Marriott Vacations Worldwide Corp	4.215.359	0,13
31.897	Match Group Inc	1.323.407	0,04
8.418	Merck & Co Inc	933.977	0,03
50.000	MetLife Inc	3.618.500	0,12
27.836	Micron Technology Inc	1.391.243	0,04
12.917	Microsoft Corp	3.097.755	0,10
96.815	Middleby Corp	12.963.528	0,40
1.677	Molson Coors Beverage Co Class B	86.399	0,00
16.778	Morgan Stanley	1.426.466	0,05
17.857	NextEra Energy Partners LP	1.251.597	0,04
49.875	NiSource Inc	1.367.572	0,04
85.751	Okta Inc Class A	5.859.366	0,19
16.491	Ormat Technologies Inc	1.426.142	0,05
44.700	Palo Alto Networks Inc	6.237.438	0,20
2.282	PepsiCo Inc	412.266	0,01
11.928	Prudential Financial Inc	1.186.359	0,04
9.000	Raytheon Technologies Corp	908.280	0,03
24.700	RXO Inc	424.840	0,01
1.650	S&P Global Inc	552.651	0,02
224	Sarepta Therapeutics Inc	29.026	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung		Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 4,32 % (31. Dezember 2021: 0,64 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
33.300	Seagate Technology Holdings Plc		1.751.913	0,06
1.219	Skechers USA Inc Class A		51.137	0,00
12.892	SolarEdge Technologies Inc		3.651.917	0,12
4.061	Starbucks Corp		402.851	0,01
21.582	STMicroelectronics NV		767.672	0,02
10.600	Take-Two Interactive Software Inc		1.103.778	0,04
8.643	T-Mobile US Inc		1.210.020	0,04
117.400	United States Steel Corp		2.940.870	0,09
5.207	VeriSign Inc		1.069.726	0,03
43.910	Viatis Inc		488.718	0,02
69.523	Vishay Intertechnology Inc		1.499.611	0,05
18.904	Walgreens Boots Alliance Inc		706.253	0,02
34.625	Wayfair Inc Class A		1.138.816	0,04
5.844	Westinghouse Air Brake Technologies Corp		583.290	0,02
11.530	Williams Cos Inc		379.337	0,01
1.842	Winnebago Industries Inc		97.073	0,00
20.547	Wynn Resorts Ltd		1.694.511	0,05
24.700	XPO Inc		822.263	0,03
25.300	ZTO Express Cayman Inc ADR		679.811	0,02
	<b>US-Dollar insgesamt</b>		<b>132.722.211</b>	<b>4,23</b>
	<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>135.368.028</b>	<b>4,32</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften 0,16 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>				
<b>US-Dollar</b>				
53.360	Omega Healthcare Investors Inc		1.491.412	0,05
44.500	Realty Income Corp		2.822.635	0,09
14.700	Ventas Inc		662.235	0,02
	<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>		<b>4.976.282</b>	<b>0,16</b>
Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Participatory Notes 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>				
<b>Euro</b>				
40.000	Epic Acquisition Corp	06.12.2026	6.404	0,00
	<b>Euro insgesamt</b>		<b>6.404</b>	<b>0,00</b>
<b>Britisches Pfund</b>				
50.000	New Energy One Acquisition Corp Plc	07.03.2027	15.036	0,00
	<b>Britisches Pfund insgesamt</b>		<b>15.036</b>	<b>0,00</b>
	<b>Participatory Notes insgesamt **</b>		<b>21.440</b>	<b>0,00</b>

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Schatzwechsel 50,57 % (31. Dezember 2021: 33,35 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
100.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	03.01.2023	100.000.000	3,20
98.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	10.01.2023	97.931.160	3,13
100.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	17.01.2023	99.857.132	3,19
70.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	24.01.2023	69.843.373	2,23
115.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	02.02.2023	114.635.610	3,66
100.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.02.2023	99.601.565	3,18
105.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.02.2023	104.478.485	3,34
100.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.02.2023	99.398.891	3,18
100.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	02.03.2023	99.317.876	3,17
120.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.03.2023	119.081.712	3,81
105.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.03.2023	104.130.285	3,33
80.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.03.2023	79.256.281	2,53
70.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	30.03.2023	69.283.766	2,21
90.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	06.04.2023	89.024.663	2,84
90.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	13.04.2023	88.985.000	2,84
75.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	20.04.2023	74.023.291	2,37
75.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	27.04.2023	73.944.372	2,36
<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>				<b>1.582.793.462</b>	<b>50,57</b>
<b>Unternehmensanleihen 5,16 % (31. Dezember 2021: 4,65 %)</b>					
<b>Euro</b>					
1.000.000	Air France-KLM*	6,50 %	29.12.2049	1.054.773	0,03
3.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	6,00 %	29.12.2049	3.121.626	0,10
5.000.000	Intesa Sanpaolo SpA*	6,38 %	29.12.2049	4.592.281	0,15
16.800.000	Intesa Sanpaolo SpA**	7,75 %	29.12.2049	17.358.287	0,56
<b>Euro insgesamt</b>				<b>26.126.967</b>	<b>0,84</b>
<b>Britisches Pfund</b>					
3.200.000	Lloyds Banking Group Plc*	7,88 %	29.12.2049	3.685.493	0,12
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>3.685.493</b>	<b>0,12</b>
<b>US-Dollar</b>					
4.000.000	2001 Cat RE Ltd**	16,82 %	08.01.2024	3.743.000	0,12
3.500.000	Alamo Re Ltd**	11,59 %	07.06.2025	3.306.275	0,11
3.000.000	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC**	12,64 %	10.06.2024	2.801.700	0,09
2.250.000	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity Co**	13,74 %	06.06.2025	2.089.687	0,07
2.250.000	Blue Halo Re Ltd*	14,09 %	24.02.2025	2.045.700	0,07
2.000.000	Blue Halo Re Ltd**	17,59 %	28.06.2023	1.988.750	0,06
1.475.000	Cape Lookout Re Ltd**	7,56 %	22.03.2024	1.395.129	0,04
2.400.000	Cape Lookout Re Ltd**	9,34 %	28.03.2025	2.258.520	0,07
1.500.000	Cosaint Re Pte Ltd**	13,85 %	03.04.2024	1.215.000	0,04
2.750.000	Everglades Re II Ltd*	10,00 %	14.05.2024	2.368.437	0,08

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 5,16 % (31. Dezember 2021: 4,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
1.000.000	First Coast Re III Pte Ltd**	10,52 %	07.04.2025	960.400	0,03
2.000.000	Herbie Re Ltd*	11,07 %	08.01.2025	1.809.500	0,06
3.000.000	Herbie Re Ltd**	13,47 %	08.07.2024	2.805.600	0,09
2.000.000	Herbie Re Ltd**	14,06 %	08.01.2025	1.752.000	0,06
1.500.000	Herbie Re Ltd*	21,59 %	06.06.2025	1.181.250	0,04
3.775.000	Hestia Re Ltd**	13,84 %	22.04.2025	3.114.375	0,10
3.000.000	Kendall Re Ltd**	8,34 %	02.05.2024	2.715.300	0,09
4.800.000	Kilimanjaro III Re Ltd**	5,25 %	25.06.2025	4.337.520	0,14
1.250.000	Kilimanjaro III Re Ltd*	8,90 %	21.04.2025	1.093.875	0,03
2.900.000	Long Point Re IV Ltd**	8,59 %	01.06.2026	2.780.012	0,09
4.750.000	Matterhorn Re Ltd**	9,57 %	24.03.2025	4.147.700	0,13
1.900.000	Matterhorn Re Ltd**	10,02 %	08.12.2025	1.534.535	0,05
3.000.000	MetroCat Re Ltd**	9,84 %	08.05.2023	2.951.250	0,09
3.000.000	Mona Lisa Re Ltd*	11,84 %	09.01.2023	2.941.875	0,09
6.420.000	Montoya Re Ltd*	11,09 %	07.04.2025	6.020.997	0,19
1.800.000	Mystic Re IV Ltd**	10,15 %	08.01.2025	1.634.940	0,05
3.500.000	Mystic Re IV Ltd*	14,09 %	08.01.2024	3.290.350	0,10
3.750.000	Northshore Re II Ltd*	10,09 %	08.01.2024	3.508.875	0,11
1.500.000	Pelican IV Re Ltd**	9,69 %	07.05.2024	26.400	0,00
3.000.000	Phoenician Re Ltd**	7,24 %	14.12.2024	2.789.400	0,09
4.000.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd*	6,84 %	06.06.2025	3.605.600	0,11
3.185.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd*	7,93 %	06.06.2025	2.846.434	0,09
1.750.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd**	9,52 %	06.12.2025	1.555.312	0,05
2.425.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd*	9,56 %	06.06.2025	2.109.144	0,07
1.500.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd*	14,25 %	06.06.2025	1.100.212	0,03
1.750.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd**	16,25 %	06.12.2025	1.545.512	0,05
1.500.000	Residential Reinsurance 2022 Ltd**	9,59 %	06.06.2026	1.302.600	0,04
3.000.000	Residential Reinsurance 2022 Ltd**	14,34 %	06.12.2026	2.997.750	0,10
3.250.000	Sanders RE II Ltd*	7,43 %	07.04.2025	3.037.775	0,10
2.250.000	Sanders RE II Ltd*	10,13 %	07.06.2023	2.212.875	0,07
3.500.000	Sanders Re III Ltd*	7,84 %	07.04.2026	3.254.825	0,10
2.050.000	Sanders Re III Ltd**	10,95 %	07.04.2027	2.054.613	0,07
3.500.000	Sanders Re III Ltd*	16,09 %	07.04.2026	3.324.125	0,11
3.250.000	Sussex Capital UK Pcc Ltd**	12,52 %	08.01.2025	2.859.188	0,09
5.000.000	Tailwind RE Ltd*	13,09 %	08.01.2025	4.402.625	0,14
250.000	Titania RE Ltd*	9,37 %	21.06.2024	225.988	0,01
4.250.000	Topanga Re Ltd**	9,09 %	08.01.2026	3.763.163	0,12
1.500.000	Ursa Re II Ltd**	8,28 %	07.12.2023	1.473.938	0,05
2.000.000	Ursa Re II Ltd**	9,34 %	16.06.2025	1.914.800	0,06
3.000.000	Ursa Re II Ltd**	11,34 %	06.12.2025	2.999.250	0,10

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Unternehmensanleihen 5,16 % (31. Dezember 2021: 4,65 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
2.250.000	Vista RE Ltd**	10,70 %	21.05.2024	2.026.519	0,06
6.000.000	ZTO Express Cayman Inc**	1,50 %	01.09.2027	6.354.000	0,20
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>131.574.600</b>	<b>4,20</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>161.387.060</b>	<b>5,16</b>
<b>Staatsanleihen 0,13 % (31. Dezember 2021: 0,44 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
3.000.000	International Bank for Reconstruction & Development	14,65 %	13.03.2024	2.892.150	0,09
4.500.000	Ukraine Government International Bond	0,00 %	01.08.2041	1.326.600	0,04
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>4.218.750</b>	<b>0,13</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>1.888.765.022</b>	<b>60,34</b>

### Devisenterminkontrakte 6,78 % (31. Dezember 2021: 0,92 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter% des Netto- Gewinn US\$ vermögens	
1.950.000 AUD	1.322.432 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	4	3.794	0,00
3.750.000 AUD	2.537.030 US\$	15.03.2023	Citibank NA	7	13.405	0,00
3.500.000 AUD	2.373.225 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	4	7.180	0,00
2.000.000 AUD	2.122.594 NZD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	14.443	0,00
10.821.072 AUD	6.000.000 £	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	122.582	0,00
55.500.000 AUD	37.416.503 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	245.188	0,01
54.400.000 AUD	4.808.533.364 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	396.037	0,01
9.710.638 AUD	6.125.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	45.532	0,00
4.400.000 AUD	4.022.920 CAD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	16.516	0,00
3.610.000 AUD	2.422.564 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	2	32.656	0,00
610.000 AUD	412.997 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Canada	1	1.873	0,00
2.500.000 AUD	1.692.294 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	11	7.997	0,00
290.000 AUD	195.228 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	2.005	0,00
4.110.000 BRL	765.742 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	4	2.561	0,00
1.410.000 BRL	263.217 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	361	0,00
1.065.366 BRL	200.000 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.783	0,00
2.650.014 BRL	500.000 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	1.921	0,00
1.420.000 CAD	1.048.521 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	74	0,00
600.000 CAD	441.155 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	3	1.914	0,00
553.453 CAD	600.000 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.344	0,00
17.204.834 CAD	11.875.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	11.366	0,00
6.600.000 CAD	637.756.982 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	27.840	0,00
60.400.000 CAD	44.310.631 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	269.982	0,01
220.000 CAD	161.656 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Canada	2	802	0,00
1.590.000 CAD	1.170.182 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	2	3.950	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 6,78 % (31. Dezember 2021: 0,92 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
6.570.000 CAD	4.838.152 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	16	13.448	0,00
70.000 CAD	51.454 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	238	0,00
6.010.000 CHF	6.480.206 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	65.807	0,00
494.328 CHF	500.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.005	0,00
7.260.592 CHF	6.375.000 £	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	8	189.294	0,01
13.875.000 CHF	14.923.362 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	99.115	0,00
520.000 CHF	565.911 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	4	467	0,00
834.810.000 CLP	957.766 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	3	12.871	0,00
702.160.000 CLP	810.293 US\$	15.03.2023	Citibank NA	3	6.111	0,00
2.499.304.837 CLP	2.800.000 US\$	23.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	128.006	0,01
703.473.941 CLP	800.000 US\$	12.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	25.066	0,00
2.128.962.477 CLP	2.400.000 US\$	09.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	97.694	0,00
88.443.703 CLP	100.000 US\$	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	3.803	0,00
1.729.851.413 CLP	1.900.000 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	130.461	0,01
263.493.110 CLP	300.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	8.816	0,00
86.420.803 CLP	100.000 US\$	13.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.348	0,00
3.908.344.377 CLP	4.500.000 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	10	81.543	0,00
88.737.703 CLP	100.000 US\$	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	3.991	0,00
85.782.703 CLP	100.000 US\$	03.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	384	0,00
3.514.360.000 CLP	4.068.300 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Canada	4	17.864	0,00
28.500.000 CLP	33.101 US\$	15.03.2023	Société Générale	1	36	0,00
28.516.000 CNY	4.000.000 US\$	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	130.686	0,01
510.389.535 CNY	73.400.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	10	461.682	0,02
171.124.450 CZK	7.393.871 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	4	138.270	0,00
2.740.000 CZK	119.540 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	1.062	0,00
9.249.986 CZK	400.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	8.331	0,00
1.180.000 CZK	51.638 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	300	0,00
117.555.550 CZK	5.090.932 US\$	15.03.2023	UBS AG	11	83.344	0,00
240.000 €	256.762 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	618	0,00
246.789 €	1.160.000 PLN	15.03.2023	Citibank NA	1	1.785	0,00
420.000 €	449.357 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	3	1.058	0,00
2.240.000 €	2.159.293 US\$	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	236.050	0,01
65.000.001 €	68.958.968 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	12	487.554	0,02
200.000 €	934.892 PLN	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	801	0,00
2.000.000 €	20.870.316 NOK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	16.841	0,00
20.500.000 €	29.227.908 CAD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	329.550	0,01
100.000 €	107.084 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	157	0,00
1.750.000 €	36.881.549 TRY	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	8.276	0,00
177.800.000 €	154.395.391 £	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	4.161.546	0,14
10.000.000 €	15.568.610 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	119.393	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 6,78 % (31. Dezember 2021: 0,92 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
5.200.000 €	729.531.830 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	15.171	0,00
2.500.000 €	27.473.525 SEK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	9	31.849	0,00
3.125.000 €	3.076.966 CHF	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	7.343	0,00
2.000.000 €	2.139.267 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	5.562	0,00
5.430.000 €	5.763.961 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	59.251	0,00
1.710.000 €	1.829.907 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	9	3.921	0,00
1.000.000 €	1.070.885 US\$	15.03.2023	UBS AG	6	1.530	0,00
786.994 €	3.710.000 PLN	15.03.2023	UBS AG	4	3.234	0,00
12.970.000 €	269.861.489 TRY	15.03.2023	UBS AG	10	237.817	0,01
50.300.000 HUF	130.543 US\$	16.03.2023	BNP Paribas	1	810	0,00
254.480.000 HUF	654.959 US\$	16.03.2023	Citibank NA	4	9.587	0,00
291.811.614 HUF	700.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	26.075	0,00
1.290.773.998 HUF	3.300.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	123.466	0,01
55.540.000 HUF	143.675 US\$	16.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.361	0,00
58.760.000 HUF	151.284 US\$	16.03.2023	Morgan Stanley	1	2.161	0,00
412.460.000 HUF	1.032.579 US\$	16.03.2023	Royal Bank of Canada	2	44.514	0,00
226.470.000 HUF	583.167 US\$	16.03.2023	UBS AG	2	8.234	0,00
14.000.000 INR	168.083 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	230	0,00
10.960.000 INR	131.568 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	198	0,00
41.482.057 INR	500.000 US\$	27.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	507	0,00
8.278.804 INR	100.000 US\$	06.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	53	0,00
140.954.283 INR	1.700.000 US\$	09.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	3.052	0,00
8.300.471 INR	100.000 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	226	0,00
82.884.843 INR	1.000.000 US\$	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	585	0,00
16.587.543 INR	200.000 US\$	23.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	199	0,00
11.510.000 INR	138.320 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	2	57	0,00
30.340.000 ¥	227.700 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	4.437	0,00
62.140.000 ¥	470.545 US\$	15.03.2023	Citibank NA	3	4.900	0,00
50.102.786 ¥	550.000 AUD	15.03.2023	Citibank NA	2	9.282	0,00
43.320.000 ¥	330.391 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	3	1.059	0,00
193.993.499 ¥	2.130.000 AUD	15.03.2023	Deutsche Bank AG	5	35.634	0,00
1.385.085.820 ¥	16.000.000 NZD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	8	397.780	0,02
110.098.098 ¥	1.210.000 AUD	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	4	19.440	0,00
5.651.707.848 ¥	34.000.000 £	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	9	2.006.796	0,07
18.493.285.649 ¥	128.700.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	2.946.216	0,10
12.287.500.000 ¥	91.175.582 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	2.143.876	0,08
9.674.363.588 ¥	105.600.000 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	1.814.561	0,07
18.128.171.114 ¥	135.787.475 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	2.914.578	0,09
1.681.414.216 ¥	16.800.000 CAD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	369.872	0,02
500.000.000 ¥	3.688.116 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	137.478	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 6,78 % (31. Dezember 2021: 0,92 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
189.807.578 ¥	2.100.000 AUD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	6	24.009	0,00
76.930.000 ¥	580.975 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	7	7.630	0,00
134.700.000 ¥	1.010.506 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	20.109	0,00
47.337.160 ¥	520.000 AUD	15.03.2023	UBS AG	1	8.525	0,00
406.650.000 KRW	315.334 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	2	8.354	0,00
654.620.000 KRW	512.828 US\$	15.03.2023	Citibank NA	3	8.241	0,00
253.820.456 KRW	200.000 US\$	03.02.2023	JPMorgan Chase Bank	2	1.830	0,00
261.202.855 KRW	200.000 US\$	13.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	7.594	0,00
394.707.447 KRW	300.000 US\$	09.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	13.242	0,00
261.058.432 KRW	200.000 US\$	06.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	6.742	0,00
259.681.914 KRW	200.000 US\$	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	5.507	0,00
126.873.528 KRW	100.000 US\$	31.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	878	0,00
127.612.528 KRW	100.000 US\$	27.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.456	0,00
1.323.150.391 KRW	1.000.000 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	46.382	0,00
1.287.581.112 KRW	1.000.000 US\$	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	23.619	0,00
783.023.636 KRW	600.000 US\$	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	22.423	0,00
1.038.917.114 KRW	800.000 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	25.772	0,00
410.180.000 KRW	324.194 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	2.304	0,00
874.150.000 KRW	674.609 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	4	21.203	0,00
3.235.490.000 KRW	2.501.740 US\$	15.03.2023	UBS AG	3	73.666	0,00
10.810.000 MXN	541.995 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	5.650	0,00
86.454.100 MXN	4.289.852 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	4	89.999	0,00
524.180.858 MXN	26.387.491 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	432.240	0,02
503.809.420 MXN	25.162.054 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	3	361.435	0,01
88.137.950 MXN	4.380.258 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	4	84.899	0,00
9.130.000 MXN	453.687 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	8.847	0,00
2.500.000 NOK	2.619.936 SEK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	2.270	0,00
17.137.378 NOK	1.625.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	4.626	0,00
3.945.257 NOK	400.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	753	0,00
1.600.000 NOK	161.986 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	927	0,00
160.000 NZD	101.114 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	160	0,00
214.869 NZD	200.000 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	207	0,00
3.000.000 NZD	248.961.480 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	6.999	0,00
150.000 NZD	94.770 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	175	0,00
7.300.000 NZD	4.599.494 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	18.434	0,00
8.410.000 PHP	150.619 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	50	0,00
30.940.000 PHP	552.856 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	1.450	0,00
8.490.000 PLN	1.892.932 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	31.046	0,00
35.034.700 PLN	7.342.953 €	15.03.2023	BNP Paribas	2	64.767	0,00
9.170.000 PLN	2.041.708 US\$	15.03.2023	Citibank NA	3	36.371	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 6,78 % (31. Dezember 2021: 0,92 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
70.615.300 PLN	14.816.477 €	15.03.2023	Citibank NA	4	113.216	0,00
2.847.937 PLN	600.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	7.450	0,00
4.028.595 PLN	900.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	17.338	0,00
5.710.000 PLN	1.198.614 €	15.03.2023	Morgan Stanley	5	8.571	0,00
2.970.000 PLN	669.485 US\$	15.03.2023	UBS AG	8	3.567	0,00
9.830.000 PLN	2.068.307 €	15.03.2023	UBS AG	10	9.563	0,00
2.122.213 SEK	2.000.000 NOK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	708	0,00
3.130.534 SEK	300.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	727	0,00
4.176.484 SEK	375.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	549	0,00
2.200.000 SEK	211.832 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	167	0,00
400.000 SGD	295.137 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	2	3.440	0,00
1.980.000 SGD	1.470.081 US\$	15.03.2023	Citibank NA	5	7.874	0,00
945.029 SGD	700.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	4.853	0,00
32.600.000 SGD	24.114.334 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	2	219.671	0,01
910.000 SGD	673.768 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	3	5.493	0,00
3.680.000 THB	106.459 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	523	0,00
13.545.226 TRY	700.000 US\$	15.02.2023	JPMorgan Chase Bank	1	11	0,00
13.699 TWD	445 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1	0,00
183.592 US\$	15.260.000 INR	15.03.2023	Barclays Bank Plc	2	131	0,00
6.720.322 US\$	23.095.000 ILS	15.03.2023	BNP Paribas	5	149.444	0,00
52.075 US\$	4.320.000 INR	15.03.2023	BNP Paribas	1	139	0,00
273.670 US\$	22.750.000 INR	15.03.2023	Citibank NA	2	161	0,00
554.683 US\$	1.900.000 ILS	15.03.2023	Citibank NA	3	14.104	0,00
372.414 US\$	1.990.000 BRL	15.03.2023	Citibank NA	2	413	0,00
89.390 US\$	140.000 NZD	15.03.2023	Citibank NA	1	775	0,00
4.087.156 US\$	79.610.000 TRY	15.03.2023	Citibank NA	2	54.047	0,00
427.817 US\$	350.000 €	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	6.054	0,00
4.084.016 US\$	79.610.000 TRY	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	50.907	0,00
567.291 US\$	5.860.000 SEK	15.03.2023	Deutsche Bank AG	3	2.602	0,00
5.516.119 US\$	4.550.000 €	09.01.2023	Goldman Sachs International	2	42.197	0,00
3.018.740 US\$	2.500.000 €	31.01.2023	Goldman Sachs International	2	9.121	0,00
1.306.350 US\$	1.000.000 €	20.03.2023	Goldman Sachs International	1	101.171	0,00
139.685 US\$	16.230.000 ¥	20.03.2023	Goldman Sachs International	1	15.417	0,00
6.800.000 US\$	888.664.800 ¥	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	658	0,00
1.800.000 US\$	148.197.210 INR	09.01.2023	JPMorgan Chase Bank	8	9.437	0,00
17.400.000 US\$	335.253.446 TRY	15.02.2023	JPMorgan Chase Bank	5	74.257	0,00
100.000 US\$	3.068.400 TWD	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	156	0,00
1.800.000 US\$	18.548.715 SEK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	18.167	0,00
3.637.895 US\$	12.405.000 ILS	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	108.485	0,00
13.091.413 US\$	1.722.306.335 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	11.072	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 6,78 % (31. Dezember 2021: 0,92 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
400.000 US\$	1.936.709.569 COP	10.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	1.069	0,00
2.200.000 US\$	11.509.876 BRL	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	22	19.995	0,00
200.000 US\$	966.424.750 COP	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	732	0,00
100.000 US\$	8.183.350 INR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.084	0,00
100.000 US\$	8.232.150 INR	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	502	0,00
4.230.998 US\$	82.500.000 MXN	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	9.883	0,00
500.000 US\$	2.406.706.875 COP	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	4.919	0,00
100.000 US\$	8.147.829 INR	06.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.530	0,00
200.000 US\$	1.966.629 NOK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	233	0,00
400.000 US\$	12.233.849 TWD	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.468	0,00
100.000 US\$	478.496.375 COP	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.625	0,00
1.300.000 US\$	6.220.119.509 COP	23.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	21.922	0,00
971.052 US\$	1.314.405 CAD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	904	0,00
100.000 US\$	3.031.312 TWD	06.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.352	0,00
10.322.221 US\$	16.200.000 NZD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	74.221	0,00
200.000 US\$	6.083.085 TWD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	1.806	0,00
204.709 US\$	300.000 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	1.132	0,00
400.000 US\$	12.224.475 TWD	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	1.373	0,00
1.300.000 US\$	6.275.705.153 COP	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	9.525	0,00
100.000 US\$	3.058.712 TWD	31.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	251	0,00
35.119.074 US\$	28.812.500 £	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	8	445.740	0,01
7.936.866 US\$	6.500.000 £	15.03.2023	Morgan Stanley	1	104.116	0,00
147.834 US\$	200.000 CAD	15.03.2023	Royal Bank of Canada	1	145	0,00
77.645 US\$	800.000 SEK	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	554	0,00
5.440.083 US\$	18.770.000 ILS	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	4	99.735	0,00
251.133 US\$	340.000 CAD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	2	61	0,00
682.960 US\$	3.640.000 BRL	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	2	2.516	0,00
147.848 US\$	12.280.000 INR	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	213	0,00
277.861 US\$	430.000 NZD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	2	5.686	0,00
1.854.216 US\$	215.000.000 ¥	16.03.2023	UBS AG	1	208.974	0,01
119.154 US\$	1.170.000 NOK	15.03.2023	UBS AG	1	23	0,00
260.169 US\$	910.000 ILS	15.03.2023	UBS AG	2	1.259	0,00
7.200.000 US\$	162.720.000 EGP	02.05.2023	Morgan Stanley	1	1.359.228	0,04
19.250.000 ZAR	1.115.054 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	2	9.511	0,00
1.910.000 ZAR	110.698 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	882	0,00
2.010.000 ZAR	116.635 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	787	0,00
19.092.200 ZAR	1.100.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	20.551	0,00
3.180.000 ZAR	185.056 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	717	0,00
30.510.000 ZAR	1.752.752 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	5	29.610	0,00
23.030.000 ZAR	1.336.818 US\$	15.03.2023	UBS AG	3	8.570	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 6,78 % (31. Dezember 2021: 0,92 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
6.338.261 CHF	6.506.154 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	16	355.464	0,01
1.567 US\$	1.441 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	7	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
20.855.189 €	20.706.746 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	1.573.463	0,05
140.518.663 €	139.699.190 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	10.421.012	0,33
144.088.629 €	143.756.286 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	59	10.177.816	0,33
163 US\$	152 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
47.964.773 £	53.854.412 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	3.865.277	0,13
1.730.628.742 £	1.944.270.533 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	138.327.727	4,42
88.693.321 £	99.819.987 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	6.911.487	0,22
164.646.646 £	187.409.693 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	47	10.722.243	0,34
5.849.318 US\$	4.853.106 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	11	9.203	0,00
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
9.018.013 ¥	62.661 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	5.819	0,00
4.547.240.910 ¥	31.315.058 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	3.214.859	0,10
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
200.888 SGD	148.714 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	1.116	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>™</sup></b>					<b>212.294.005</b>	<b>6,78</b>

### Futures-Kontrakte 1,30 % (31. Dezember 2021: 0,67 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
259	1 Month SOFR Future February 2023	16.210	0,00
(6)	10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2023	2.045	0,00
(161)	3 Month SOFR Future December 2023	1.900	0,00
(38)	3 Month SOFR Future December 2024	2.037	0,00
(1.200)	3 Month SOFR Future February 2023	67.300	0,00
(800)	3 Month SOFR Future January 2023	135.472	0,00
(671)	3 Month SOFR Future June 2023	46.583	0,00
(1.200)	3 Month SOFR Future March 2023	88.003	0,00
(2.910)	3 Month SOFR Future March 2024	2.093.495	0,07
(399)	3 Month SOFR Future September 2023	75.850	0,00
(63)	3 Month SOFR Future September 2024	30.562	0,00
(70)	3 Month SONIA Future December 2024	33.320	0,00
(37)	3 Month SONIA Future June 2025	16.600	0,00
(99)	3 Month SONIA Future March 2025	48.327	0,00
(65)	3 Month SONIA Future September 2023	6.902	0,00
(130)	3 Month SONIA Future September 2025	31.892	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 1,30 % (31. Dezember 2021: 0,67 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
428	30 Day Federal Funds Future February 2023	33.086	0,00
(786)	3-Month Euro Euribor Future December 2023	173.031	0,01
(2.098)	3-Month Euro Euribor Future June 2023	1.437.636	0,05
(89)	3-Month Euro Euribor Future June 2024	43.984	0,00
(166)	3-Month Euro Euribor Future June 2025	95.866	0,00
(142)	3-Month Euro Euribor Future March 2024	171.841	0,01
(30)	3-Month Euro Euribor Future March 2025	43.264	0,00
(1.649)	3-Month Euro Euribor Future September 2023	652.681	0,02
(161)	90-Day Bank Bill Future September 2023	33.497	0,00
(1)	Amsterdam Index Future January 2023	1.462	0,00
8	Australian Dollar Currency Future March 2023	5.805	0,00
(67)	Australian Government Bond 10-Year Future March 2023	32.417	0,00
(79)	Australian Government Bond 3-Year Future March 2023	41.797	0,00
(106)	Bankers Acceptance Future December 2023	52.050	0,00
(211)	Bankers Acceptance Future June 2023	65.584	0,00
(34)	Bankers Acceptance Future March 2023	16.652	0,00
(2)	Bankers Acceptance Future March 2024	92	0,00
(409)	Bankers Acceptance Future September 2023	101.304	0,00
(1)	Brazil Real Currency Future January 2023	135	0,00
(929)	British Pound Currency Future March 2023	562.214	0,02
(376)	CAC40 Index Future January 2023	500.962	0,02
(400)	Canadian 10-Year Bond Future March 2023	360.353	0,01
(16)	Canadian 5-Year Bond Future March 2023	15.440	0,00
372	Canadian Dollar Currency Future March 2023	26.119	0,00
(68)	CBOE VIX Index Future February 2023	37.756	0,00
(225)	CBOE VIX Index Future January 2023	360.431	0,01
(184)	CBOE VIX Index Future March 2023	134.880	0,01
(1)	Chinese Yuan Renminbi Currency Future March 2023	597	0,00
(40)	DAX Index Future March 2023	168.704	0,01
(17)	Dollar Index Future March 2023	2.092	0,00
1	E-mini Consumer Discretionary Future March 2023	80	0,00
3	E-mini Energy Select Sector Index Future March 2023	3.470	0,00
1	E-mini Industrial Future March 2023	150	0,00
1	E-mini Utilities Future March 2023	290	0,00
480	Euro Bund Futures January 2023	2.947.637	0,10
(480)	Euro Bund Futures January 2023	756.633	0,02
1.185	Euro FX Currency Future March 2023	514.862	0,02
1.600	Euro STOXX 50 Dividend Index Future December 2023	60.292	0,01
(24)	Euro STOXX 50 Future January 2023	0	0,00
(640)	Euro STOXX 50 Future March 2023	238.733	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 1,30 % (31. Dezember 2021: 0,67 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1	Euro STOXX 50 Index Dividend Future December 2023	11	0,00
38	Euro STOXX Bank Index Future March 2023	955	0,00
1	Euro/Pound Sterling Currency Future March 2023	789	0,00
(2.032)	Euro-BOBL Future March 2023	3.384.869	0,11
(595)	Euro-BTP Future March 2023	4.576.419	0,15
(1.164)	Euro-Bund Future March 2023	2.728.275	0,09
(46)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	458.170	0,02
(866)	Euro-OAT Future March 2023	7.790.746	0,25
(4.662)	Euro-Schatz Future March 2023	1.191.168	0,04
(161)	FTSE 100 Index Future March 2023	86.491	0,00
22	FTSE China A50 Index Future July 2023	153	0,00
(43)	FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2023	31.182	0,00
(1)	FTSE/MIB Index Future March 2023	82	0,00
9	Hang Seng China Enterprises Index Future February 2023	391	0,00
(127)	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2023	1.525.284	0,05
142	Japanese Yen Currency Future March 2023	87.421	0,00
(1)	Long Swiss Confederation Bond Future March 2023	4.983	0,00
72	Mexican Peso Currency Future March 2023	38.160	0,00
(4)	Mini-DAX Future March 2023	1.174	0,00
(19)	MSCI Emerging Markets Index Future March 2023	1.240	0,00
(1)	MSCI Singapore Index Future February 2023	48	0,00
401	New Zealand Dollar Currency Future March 2023	28.748	0,00
(9)	Nikkei 225 (CME) Future March 2023	18.650	0,00
(7)	Nikkei 225 (OSE) Future March 2023	15.461	0,00
(39)	Nikkei 225 (SGX) Future March 2023	55.705	0,00
(190)	Nikkei 225 Mini Future March 2023	19.686	0,00
(1)	S&P 500 E-mini Future December 2022	11.901	0,00
(614)	S&P 500 E-mini Future March 2023	1.857.942	0,06
184	SGX Nifty 50 Future January 2023	30.864	0,00
(47)	Short-Term Euro-BTP Future March 2023	13.373	0,00
131	South African Rand Currency (CME) Future March 2023	121.025	0,00
(37)	SPI 200 Index Future March 2023	47.555	0,00
9	Swedish Krona Currency Future March 2023	12.684	0,00
281	Swiss Franc Currency Future March 2023	126.393	0,01
(2)	TOPIX Index Future March 2023	720	0,00
7	Turkish Lira Currency Future February 2023	24	0,00
(111)	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	341.067	0,01
(1)	United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Future March 2023	175	0,00
(1.091)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	913.138	0,03
(22)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2023	18.188	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 1,30 % (31. Dezember 2021: 0,67 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(149)	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	14.178	0,00
(2.276)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	1.675.765	0,05
(758)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	936.431	0,03
(1)	VSTOXX Future January 2023	0	0,00
659	WIG 20 Index Future December 2049	68.548	0,00
(6)	Yen Denominated Nikkei Future March 2023	17.242	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>±</sup></b>		<b>40.643.851</b>	<b>1,30</b>

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufoptionen</b>				
4.000	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 <sup>±</sup>	2.230.000	0,08
11.600	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$96 <sup>±</sup>	132.500	0,00
3.200	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$96 <sup>±</sup>	90.000	0,00
1.500	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$97 <sup>±</sup>	9.375	0,00
200	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$97 <sup>±</sup>	1.250	0,00
82	20.01.2023	AbbVie Inc, Strike Price \$185 <sup>±</sup>	287	0,00
5.000.000 USD	17.02.2023	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 36% <sup>∞</sup>	1.505	0,00
20.000.000 USD	20.01.2023	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 19% <sup>∞</sup>	123.955	0,00
10.000.000 USD	17.03.2023	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 22% <sup>∞</sup>	8.710	0,00
79	17.03.2023	Acciona SA, Strike Price EUR230 <sup>±</sup>	0	0,00
39	17.03.2023	Adobe Inc, Strike Price \$490 <sup>±</sup>	1.540	0,00
34	16.06.2023	AECOM, Strike Price \$93 <sup>±</sup>	9.520	0,00
30	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$100 <sup>±</sup>	18.300	0,00
500.000.000 JPY	22.04.2027	Aica Kogyo Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. <sup>∞</sup>	318.319	0,01
72.044	18.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$110 <sup>∞</sup>	277.621	0,01
71.992	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$110 <sup>∞</sup>	283.097	0,01
71.923	22.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$110 <sup>∞</sup>	285.854	0,01
160.358	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$115 <sup>∞</sup>	463.474	0,01
166.666	18.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$146 <sup>∞</sup>	62.521	0,00
166.667	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$146 <sup>∞</sup>	64.396	0,00
166.667	22.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$146 <sup>∞</sup>	65.680	0,00
400.000	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$152 <sup>∞</sup>	100.936	0,00
1.610	20.01.2023	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$88 <sup>±</sup>	261.625	0,01
87	21.04.2023	Allstate Corp, Strike Price \$145 <sup>±</sup>	36.105	0,00
71	20.01.2023	AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$175 <sup>±</sup>	5.680	0,00
42	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$285 <sup>±</sup>	1.155	0,00
900.000.000 JPY	05.09.2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 52bps. <sup>∞</sup>	0	0,00
170.000.000 JPY	20.08.2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. <sup>∞</sup>	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
6	20.01.2023	Anthem Inc, Strike Price \$520 ±	5.370	0,00
8	20.01.2023	Anthem Inc, Strike Price \$580 ±	420	0,00
46.946	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$43 ∞	999.218	0,03
400.000	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$51 ∞	7.194.024	0,23
63	20.01.2023	Applied Materials Inc, Strike Price \$160 ±	157	0,00
982	20.01.2023	Archaea Energy Inc, Strike Price \$30 ±	0	0,00
502	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$24 ±	502	0,00
14	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$210 ±	10.430	0,00
1.000.000 USD	10.02.2025	Worst of autocallable on S&P 500® Index ("SPX"), Russell 2000® Index ("RTY"), Nasdaq-100 Index® ("NDX") ∞	83.973	0,00
93	20.01.2023	Best Buy Co Inc, Strike Price \$110 ±	93	0,00
6.605	31.05.2023	BNP Paribas PMS, Strike Price CNH9,593 ∞	700.418	0,02
310	17.03.2023	Britannia Bulk Holdings Inc, Strike Price EUR56 ∞	47.375	0,00
6	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$570 ±	29.040	0,00
2	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$580 ±	6.400	0,00
152	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$110 ±	3.420	0,00
33	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$90 ±	13.200	0,00
216	20.01.2023	Centene Corp, Strike Price \$95 ±	1.728	0,00
126.665	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105 ∞	557.462	0,02
450.000	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$133 ∞	1.129.885	0,04
76	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$300 ±	251.180	0,01
9	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$350 ±	16.695	0,00
59	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$53 ±	9.027	0,00
645	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$23 ±	15.157	0,00
229	20.01.2023	Comcast Corp, Strike Price \$53 ±	0	0,00
117.000	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price \$138 ∞	416.833	0,01
117.000	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price \$138 ∞	426.874	0,01
116.000	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price \$138 ∞	427.186	0,01
11.700	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price \$76 ∞	70.260	0,00
11.700	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price \$76 ∞	71.562	0,00
11.600	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price \$76 ∞	71.895	0,00
60.469	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price \$111 ∞	1.312.657	0,04
10.078	19.01.2027	Conmed Corp, Strike Price \$111 ∞	218.773	0,01
210.000	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price \$249 ∞	1.146.847	0,04
10	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$95 ±	950	0,00
1.407	17.03.2023	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR11 ±	17.269	0,00
104	20.01.2023	CVS Caremark Corp, Strike Price \$125 ±	208	0,00
900.000.000 JPY	16.11.2029	Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 170bps. ∞	1.127.440	0,04
550.000.000 JPY	17.02.2023	Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 90bps. ∞	3.648	0,00
6	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$165 ±	855	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
39	20.01.2023	Deere & Company, Strike Price \$420 ±	64.935	0,00
2.173.493	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21 ∞	2.423.685	0,08
2.173.493	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21 ∞	2.754.383	0,09
2.173.493	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR22 ∞	1.925.265	0,07
2.173.493	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR22 ∞	2.230.177	0,07
11	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$80 ±	1.265	0,00
113	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$180 ±	452	0,00
1.600.000 USD	16.06.2023	Dual digital option: S&P 500 index and SOFR rate, Strike Price \$3,555 and 3.86% ∞	74.560	0,00
800.000 USD	15.12.2023	Dual digital option: Euro STOXX 50 index and EUR/USD spot rate, Strike Price \$4,000 and 1.1 ∞	220.724	0,01
13	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$80 ±	1.300	0,00
160	20.01.2023	Eastman Chemical Co, Strike Price \$110 ±	2.400	0,00
229	20.01.2023	Edison International, Strike Price \$80 ±	0	0,00
476	20.01.2023	Enterprise Products Co, Strike Price \$27 ±	476	0,00
110.000	19.09.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$111 ∞	1.188.838	0,04
110.000	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$111 ∞	1.208.696	0,04
110.000	19.11.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$111 ∞	1.235.582	0,04
92.400	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	1.834.914	0,06
164	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,825 ±	81.213	0,00
192	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,900 ±	166.389	0,01
80	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,075 ±	24.333	0,00
120	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,275 ±	8.453	0,00
71,000.000 EUR	16.01.2023	Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price EUR1 ∞	41	0,00
6	16.06.2023	FactSet Research Systems Inc, Strike Price \$500 ±	2.490	0,00
200,000.000 JPY	18.03.2024	Fancl Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. ∞	15.691	0,00
74	21.04.2023	FedEx Corp, Strike Price \$195 ±	42.180	0,00
672	20.01.2023	FirstEnergy Corp, Strike Price \$50 ±	3.360	0,00
23	21.04.2023	Fluor Corp, Strike Price \$40 ±	3.795	0,00
688	17.03.2023	Freenet AG, Strike Price EUR26 ±	734	0,00
99	20.01.2023	General Electric Co, Strike Price \$110 ±	247	0,00
14	21.04.2023	General Mills Inc, Strike Price \$88 ±	3.430	0,00
37	16.06.2023	General Mills Inc, Strike Price \$90 ±	9.435	0,00
800,000.000 JPY	08.06.2026	GMO Payment Gateway Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. ∞	300.405	0,01
29.267	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$108 ∞	18.146	0,00
200.000	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$126 ∞	96.772	0,00
452	17.03.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$48 ±	29.380	0,00
113	20.01.2023	Hess Corp, Strike Price \$120 ±	255.380	0,01
100,000.000 JPY	05.09.2024	Hosele Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. ∞	21.787	0,00
30	20.01.2023	Humana Inc, Strike Price \$490 ±	84.900	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
477	13.03.2023	IMM Eurodollar Future, Strike Price \$95 ±	295.144	0,01
41.929	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$294 ∞	2.521.593	0,08
170	16.06.2023	Insulet Corp, Strike Price \$310 ±	527.000	0,02
200.000	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$317 ∞	9.897.803	0,32
34.328	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$319 ∞	1.675.675	0,05
150.000	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$350 ∞	5.516.551	0,18
30	21.04.2023	Interpublic Group of Cos Inc, Strike Price \$36 ±	3.450	0,00
34	16.06.2023	ITT Inc, Strike Price \$95 ±	8.415	0,00
1.259	20.01.2023	Jabil Inc, Strike Price \$75 ±	28.328	0,00
6	21.04.2023	JM Smucker Co, Strike Price \$160 ±	4.170	0,00
18	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$195 ±	4.383	0,00
273	17.03.2023	Kellogg Co, Strike Price \$85 ±	2.730	0,00
1.032	20.01.2023	KeyCorp, Strike Price \$20 ±	3.096	0,00
1.318	20.01.2023	KeyCorp, Strike Price \$22 ±	6.590	0,00
796	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$22 ±	3.980	0,00
16	16.06.2023	Keysight Technologies Inc, Strike Price \$195 ±	9.840	0,00
23	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$145 ±	9.545	0,00
136	20.01.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$150 ±	1.088	0,00
1,070.000.000 JPY	20.12.2024	Koei Tecmo Holdings Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞	535.253	0,02
12	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW293 ±	7.995	0,00
5	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW295 ±	2.303	0,00
20	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW298 ±	5.931	0,00
72	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW325 ±	285	0,00
24	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW328 ±	47	0,00
186	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW330 ±	368	0,00
16	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW333 ±	32	0,00
30	17.03.2023	Kr1 Plc, Strike Price EUR650 ∞	1.205	0,00
29	21.04.2023	Kraft Heinz Co, Strike Price \$43 ±	3.988	0,00
200,000.000 JPY	15.01.2026	Kyoritsu Maintenance, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 105bps. ∞	496.071	0,02
350,000.000 JPY	13.01.2026	Kyoritsu Maintenance, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. ∞	838.380	0,03
15	20.01.2023	Lam Research Corp, Strike Price \$640 ±	15	0,00
5.652	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$33 ±	180.864	0,01
1.035	20.01.2023	Lyft Inc, Strike Price \$40 ±	1.035	0,00
601	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$40 ±	9.916	0,00
168.821	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$42 ∞	24.283	0,00
800.000	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$49 ∞	70.391	0,00
214.527	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$56 ∞	12.127	0,00
1.000.000	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$60 ∞	46.833	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
171	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$105 ±	3.847	0,00
94	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$33 ±	15.369	0,00
76.564	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$153 ∞	1.065.974	0,03
275.950	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$197 ∞	1.212.979	0,04
2.114	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$110 ±	128.954	0,00
960	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$115 ±	44.640	0,00
76.632	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$126 ∞	17.998	0,00
124.502	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$133 ∞	22.393	0,00
200	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$140 ±	7.500	0,00
742	20.01.2023	Match Group Inc, Strike Price \$145 ±	0	0,00
1.157	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$145 ±	39.916	0,00
103.560	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$164 ∞	6.888	0,00
240.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$172 ∞	12.759	0,00
400.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$182 ∞	16.287	0,00
350.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$225 ∞	5.388	0,00
530.000.000 JPY	29.01.2025	Menicon Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. ∞	240.527	0,01
159	20.01.2023	Merck & Co Inc, Strike Price \$100 ±	180.862	0,01
284	17.03.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$68 ±	7.100	0,00
187	20.01.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$83 ±	187	0,00
54	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$335 ±	675	0,00
68.636	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$178 ∞	604.088	0,03
76.824	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$192 ∞	511.529	0,02
75.004	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$193 ∞	488.385	0,02
240.000	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$201 ∞	1.337.653	0,04
300.000	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$210 ∞	1.415.095	0,05
225.000	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$227 ∞	803.892	0,03
18	21.04.2023	Molson Coors Beverage Co, Strike Price \$58 ±	1.620	0,00
219	17.03.2023	Morgan Stanley, Strike Price \$100 ±	12.592	0,00
1.580	17.03.2023	MSCI World Index, Strike Price \$2,278 ∞	15.398	0,00
1,020.000.000 JPY	12.11.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 38bps. ∞	170.277	0,01
1,000.000.000 JPY	11.12.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. ∞	150.977	0,01
370.000.000 JPY	27.11.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞	60.636	0,00
9	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,750 ±	887	0,00
153	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,875 ±	12.755	0,00
13	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,000 ±	887	0,00
7	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,125 ±	424	0,00
3	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,250 ±	136	0,00
1,200.000.000 JPY	04.10.2024	Nippon 24, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. ∞	750.406	0,02

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
1,200.000.000 JPY	05.10.2026	Nippon 26, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 65bps. <sup>∞</sup>	1.156.220	0,04
400,000.000 JPY	16.09.2024	Nipro Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. <sup>∞</sup>	29.508	0,00
200,000.000 JPY	27.09.2024	Nipro Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. <sup>∞</sup>	17.602	0,00
538	21.04.2023	NiSource Inc, Strike Price \$30 <sup>±</sup>	29.590	0,00
384	20.01.2023	NortonLifeLock Inc, Strike Price \$32 <sup>±</sup>	3.840	0,00
3.246	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$170 <sup>±</sup>	556.689	0,02
49.339	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$220 <sup>∞</sup>	30.018	0,00
64.205	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$223 <sup>∞</sup>	37.384	0,00
200.000	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$258 <sup>∞</sup>	64.372	0,00
250.000	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$261 <sup>∞</sup>	77.336	0,00
73	17.01.2025	Okta Inc, Strike Price \$70 <sup>±</sup>	180.310	0,01
702	17.03.2023	Omega Healthcare Investors Inc, Strike Price \$36 <sup>±</sup>	8.775	0,00
75.000	21.11.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$194 <sup>∞</sup>	1.940.498	0,06
1,900.000.000 JPY	17.10.2025	Park24 Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 53bps. <sup>∞</sup>	0	0,00
16	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$200 <sup>±</sup>	4.968	0,00
2.520.000 USD	20.03.2023	GBP/USD & USD/JPY dual digital (both Down Knock Ins), Strike Prices: \$1.12 & JPY139.5 <sup>∞</sup>	123.493	0,00
370	20.01.2023	PPL Corporation, Strike Price \$35 <sup>±</sup>	3.700	0,00
220	17.03.2023	Prudential Financial Inc, Strike Price \$115 <sup>±</sup>	13.750	0,00
15.005	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$25 <sup>±</sup>	3.413.637	0,11
12.410	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$27 <sup>±</sup>	1.303.050	0,04
368.894	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$29 <sup>∞</sup>	153.933	0,01
291.934	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$31 <sup>∞</sup>	32.959	0,00
1.500.000	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$35 <sup>∞</sup>	32.995	0,00
1.200.000	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$39 <sup>∞</sup>	8.063	0,00
194	20.01.2023	Raytheon Technologies Corp, Strike Price \$105 <sup>±</sup>	12.222	0,00
263	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$85 <sup>±</sup>	1.315	0,00
250,000.000 JPY	17.11.2027	Relo Group Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 87bps. <sup>∞</sup>	62.732	0,00
635	17.03.2023	Rocket Companies Inc, Strike Price \$7 <sup>±</sup>	46.990	0,00
5	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,800 <sup>±</sup>	28.125	0,00
4	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,840 <sup>±</sup>	17.550	0,00
8	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,850 <sup>±</sup>	32.800	0,00
25	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,860 <sup>±</sup>	95.625	0,00
5	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,900 <sup>±</sup>	14.188	0,00
638	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,950 <sup>±</sup>	1.164.350	0,04
24	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,600 <sup>±</sup>	780.720	0,03
31	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,850 <sup>±</sup>	491.195	0,02
15	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,855 <sup>±</sup>	233.475	0,01
16	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,860 <sup>±</sup>	244.640	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
15	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,950 <sup>±</sup>	44.175	0,00
24	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,040 <sup>±</sup>	168.480	0,01
8	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,190 <sup>±</sup>	980	0,00
4	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,225 <sup>±</sup>	9.800	0,00
120	15.12.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 <sup>±</sup>	1.894.800	0,06
3	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,550 <sup>±</sup>	30	0,00
1	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,600 <sup>±</sup>	10	0,00
93	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$200 <sup>±</sup>	93	0,00
48.561	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$83 <sup>∞</sup>	2.867.206	0,09
400.000	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$97 <sup>∞</sup>	19.980.545	0,64
1,150.000.000 JPY	25.07.2025	SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. <sup>∞</sup>	550.127	0,02
1,200.000.000 JPY	11.07.2025	SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. <sup>∞</sup>	657.211	0,02
1,000.000.000 JPY	25.07.2025	SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. <sup>∞</sup>	551.991	0,02
105	20.01.2023	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$110 <sup>±</sup>	0	0,00
200,000.000 JPY	17.03.2026	Seino Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. <sup>∞</sup>	2.681	0,00
800,000.000 JPY	17.03.2026	Seino Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 45bps. <sup>∞</sup>	0	0,00
21	21.04.2023	Skechers USA Inc, Strike Price \$45 <sup>±</sup>	5.670	0,00
600	17.03.2023	Société Générale SA, Strike Price EUR26 <sup>±</sup>	26.575	0,00
40	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$370 <sup>±</sup>	32.600	0,00
27	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$105 <sup>±</sup>	17.145	0,00
337	20.01.2023	STMicroelectronics NV, Strike Price \$45 <sup>±</sup>	0	0,00
977	20.01.2023	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$30 <sup>±</sup>	4.885	0,00
67.492	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$38 <sup>∞</sup>	110.215	0,00
400.000	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$48 <sup>∞</sup>	373.836	0,01
480	20.01.2023	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, Strike Price \$15 <sup>±</sup>	1.920	0,00
480.000	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price \$162 <sup>∞</sup>	6.863.219	0,22
200,000.000 JPY	13.11.2026	Transcosmos Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 45bps. <sup>∞</sup>	157.541	0,01
45	17.03.2023	Ulta Beauty Inc, Strike Price \$430 <sup>±</sup>	256.725	0,01
40,800.000 JPY	21.06.2023	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price \$136 <sup>∞</sup>	223.875	0,01
NOK102,000.000	17.01.2023	United States Dollar/Norwegian Krone Currency Option, Strike Price \$10 <sup>∞</sup>	765.685	0,03
67	16.06.2023	Unum Group, Strike Price \$45 <sup>±</sup>	13.735	0,00
800	27.01.2023	US Treasury 10-Year Note Futures, Strike Price \$116 <sup>±</sup>	87.500	0,00
244	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$65 <sup>±</sup>	1.220	0,00
320	18.01.2023	VIX Index, Strike Price \$27 <sup>±</sup>	19.840	0,00
800	18.01.2023	VIX Index, Strike Price \$35 <sup>±</sup>	18.800	0,00
318	20.01.2023	Walgreens Boots Alliance Inc, Strike Price \$50 <sup>±</sup>	477	0,00
1.803	20.01.2023	Wayfair Inc, Strike Price \$160 <sup>±</sup>	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
1.019	20.01.2023	Wayfair Inc, Strike Price \$190 ±	0	0,00
715	20.01.2023	Wayfair Inc, Strike Price \$195 ±	0	0,00
513	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$195 ±	34.627	0,00
300	20.01.2023	Wayfair Inc, Strike Price \$200 ±	0	0,00
41.564	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$210 ∞	8.134	0,00
87.267	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$253 ∞	8.977	0,00
20.000	09.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$268 ∞	1.802	0,00
160.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$268 ∞	14.420	0,00
160.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$322 ∞	8.025	0,00
200.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$324 ∞	9.881	0,00
91	16.06.2023	Williams Companies Inc, Strike Price \$37 ±	8.873	0,00
12	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$70 ±	1.080	0,00
110	20.01.2023	XPO Logistics Inc, Strike Price \$88 ±	0	0,00
170.000.000 JPY	20.06.2024	Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. ∞	189.740	0,01
500.000.000 JPY	21.05.2024	Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. ∞	569.293	0,02
<b>Verkaufsoptionen</b>				
200	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$93 ±	1.250	0,00
3.500	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$94 ±	21.875	0,00
2.600	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	56.250	0,00
6.700	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	1.476.875	0,05
283	17.03.2023	Acciona SA, Strike Price EUR140 ±	14.498	0,00
104	17.03.2023	Acciona SA, Strike Price EUR170 ±	66.263	0,00
65	17.03.2023	Acciona SA, Strike Price EUR200 ±	195.211	0,01
1.306	16.06.2023	Accor SA, Strike Price EUR12 ±	16.726	0,00
82	17.03.2023	Adobe Inc, Strike Price \$300 ±	80.975	0,00
51	17.03.2023	Adobe Inc, Strike Price \$360 ±	182.070	0,01
39	17.03.2023	Adobe Inc, Strike Price \$430 ±	366.795	0,01
111	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$65 ±	35.797	0,00
93	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$78 ±	119.970	0,00
43	16.06.2023	AECOM, Strike Price \$73 ±	8.278	0,00
10	16.06.2023	AECOM, Strike Price \$85 ±	5.000	0,00
7	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$65 ±	2.240	0,00
39	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$75 ±	23.010	0,00
31	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$90 ±	39.060	0,00
4.567	20.01.2023	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$65 ±	0	0,00
136	21.04.2023	Allstate Corp, Strike Price \$110 ±	18.020	0,00
84	21.04.2023	Allstate Corp, Strike Price \$130 ±	43.260	0,00
13.483	19.05.2023	American Airlines Group Inc, Strike Price \$9 ±	519.096	0,02

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
148	20.01.2023	AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$105 <sup>±</sup>	7.252	0,00
85	20.01.2023	AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$130 <sup>±</sup>	0	0,00
64	20.01.2023	AmerisourceBergen Corp, Strike Price \$155 <sup>±</sup>	7.520	0,00
94	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$175 <sup>±</sup>	0	0,00
42	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$210 <sup>±</sup>	210	0,00
29	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$245 <sup>±</sup>	3.132	0,00
32.274	16.06.2023	ams AG, Strike Price CHF4 <sup>±</sup>	802.315	0,03
30.993	17.03.2023	ams AG, Strike Price CHF6 <sup>±</sup>	937.964	0,03
11	20.01.2023	Anthem Inc, Strike Price \$310 <sup>±</sup>	0	0,00
7	20.01.2023	Anthem Inc, Strike Price \$380 <sup>±</sup>	157	0,00
6	20.01.2023	Anthem Inc, Strike Price \$450 <sup>±</sup>	705	0,00
433	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$18 <sup>±</sup>	13.206	0,00
341	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$21 <sup>±</sup>	97.526	0,00
29	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$130 <sup>±</sup>	19.430	0,00
18	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$160 <sup>±</sup>	29.250	0,00
15	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$185 <sup>±</sup>	44.775	0,00
46.716	16.06.2023	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3 <sup>±</sup>	99.715	0,00
11.800	15.09.2023	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3 <sup>±</sup>	62.968	0,00
3.689	16.06.2023	Banco BPM SpA, Strike Price EUR2 <sup>±</sup>	129.924	0,00
521	17.03.2023	BNP Paribas SA, Strike Price EUR35 <sup>∞</sup>	11.121	0,00
335	17.03.2023	Britannia Bulk Holdings Inc, Strike Price EUR42 <sup>∞</sup>	15.748	0,00
271	17.03.2023	Britannia Bulk Holdings Inc, Strike Price EUR48 <sup>∞</sup>	31.281	0,00
4	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$360 <sup>±</sup>	780	0,00
12	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$360 <sup>±</sup>	5.220	0,00
2	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$430 <sup>±</sup>	1.190	0,00
6	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$440 <sup>±</sup>	7.560	0,00
15	20.01.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$480 <sup>±</sup>	1.575	0,00
2	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$510 <sup>±</sup>	4.040	0,00
6	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$510 <sup>±</sup>	16.740	0,00
9.233	16.06.2023	Carnival Corp, Strike Price \$6 <sup>±</sup>	600.145	0,02
178	03.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,500 <sup>±</sup>	2.225	0,00
12.250	16.06.2023	Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR26 <sup>±</sup>	1.398.898	0,05
492	20.01.2023	Centene Corp, Strike Price \$58 <sup>±</sup>	0	0,00
69	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$60 <sup>±</sup>	7.245	0,00
377	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$65 <sup>±</sup>	23.562	0,00
277	20.01.2023	Centene Corp, Strike Price \$70 <sup>±</sup>	4.847	0,00
45	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$70 <sup>±</sup>	10.688	0,00
195	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$80 <sup>±</sup>	66.300	0,00
204	20.01.2023	Centene Corp, Strike Price \$83 <sup>±</sup>	44.370	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
34	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$83 ±	21.250	0,00
140	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$95 ±	184.100	0,01
217	17.03.2023	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$40 ±	11.393	0,00
1.465	17.03.2023	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$70 ±	1.333.150	0,04
8	17.03.2023	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,660 ±	221.720	0,01
175	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$180 ±	0	0,00
86	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$220 ±	430	0,00
24	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$220 ±	4.500	0,00
65	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$260 ±	1.300	0,00
12	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$270 ±	6.960	0,00
9	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$320 ±	16.335	0,00
347	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$33 ±	11.104	0,00
83	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$40 ±	8.674	0,00
167	20.01.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$42 ±	1.336	0,00
58	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$48 ±	19.140	0,00
1.086	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$14 ±	95.568	0,00
788	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$17 ±	175.330	0,01
679	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$20 ±	295.365	0,01
440	21.04.2023	Confluent Inc, Strike Price \$18 ±	75.900	0,00
910	19.05.2023	CONMED Corp, Strike Price \$55 ±	172.900	0,01
23	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$60 ±	2.185	0,00
14	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$70 ±	3.885	0,00
9	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$85 ±	8.820	0,00
1.311	17.03.2023	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR10 ±	70.658	0,00
47.465	16.06.2023	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR5 ±	303.942	0,01
2.657	17.03.2023	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR7 ±	12.761	0,00
1.668	17.03.2023	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR9 ±	18.692	0,00
23.933	16.06.2023	Credit Suisse Group AG, Strike Price CHF3 ±	1.707.283	0,06
75	20.01.2023	CVS Caremark Corp, Strike Price \$95 ±	24.562	0,00
13	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$100 ±	1.268	0,00
7	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$125 ±	3.115	0,00
5	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$145 ±	6.450	0,00
80	20.01.2023	Deere & Company, Strike Price \$250 ±	640	0,00
45	20.01.2023	Deere & Company, Strike Price \$310 ±	450	0,00
36	20.01.2023	Deere & Company, Strike Price \$360 ±	1.620	0,00
36.203	17.03.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR4 ±	154.551	0,01
6.400	16.06.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR4 ±	58.058	0,00
3.740	17.03.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR5 ±	23.949	0,00
250	15.09.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR6 ±	7.738	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
14.281	15.12.2023	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR12 ±	381.035	0,01
1.395.000	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	1.623.112	0,06
1.395.000	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	1.683.088	0,06
20	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$50 ±	4.540	0,00
13	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$60 ±	7.573	0,00
11	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$70 ±	13.118	0,00
726	17.03.2023	DiaSorin Italia SpA, Strike Price EUR94 ±	72.469	0,00
277	17.03.2023	DiaSorin Italia SpA, Strike Price EUR96 ±	29.285	0,00
29	20.01.2023	Dollar General Corp, Strike Price \$250 ±	21.750	0,00
221	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$110 ±	2.210	0,00
142	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$130 ±	11.289	0,00
109	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$155 ±	150.692	0,01
2.825	17.03.2023	Dufry AG, Strike Price CHF22 ±	83.968	0,00
8.071	16.06.2023	Dufry AG, Strike Price CHF26 ±	959.587	0,03
440	17.03.2023	Dufry AG, Strike Price CHF28 ±	26.394	0,00
839	15.09.2023	Dufry AG, Strike Price CHF28 ±	158.695	0,01
33	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$50 ±	990	0,00
16	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$60 ±	2.200	0,00
11	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$70 ±	5.390	0,00
160	20.01.2023	Eastman Chemical Co, Strike Price \$65 ±	2.400	0,00
98	17.03.2023	Edenred, Strike Price EUR38 ±	3.242	0,00
339	20.01.2023	Edison International, Strike Price \$48 ±	0	0,00
220	20.01.2023	Edison International, Strike Price \$60 ±	10.450	0,00
176	20.01.2023	Edison International, Strike Price \$70 ±	117.040	0,00
1.009	20.01.2023	Enterprise Products Co, Strike Price \$17 ±	1.009	0,00
557	20.01.2023	Enterprise Products Co, Strike Price \$20 ±	1.114	0,00
1.650	19.05.2023	Envestnet Inc, Strike Price \$45 ±	288.750	0,01
35.000	20.12.2024	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,200 ∞	1.050.639	0,03
2.010	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,273 ∞	65.373	0,00
960	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,300 ±	271.508	0,01
606	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,625 ±	132.584	0,00
1.167	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,750 ±	673.805	0,02
167	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,800 ±	136.347	0,01
10	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,825 ±	9.595	0,00
1.020	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,850 ±	1.143.025	0,04
128	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,900 ±	267.342	0,01
8	16.06.2023	FactSet Research Systems Inc, Strike Price \$380 ±	15.400	0,00
5	16.06.2023	FactSet Research Systems Inc, Strike Price \$450 ±	28.225	0,00
76	21.04.2023	FedEx Corp, Strike Price \$150 ±	40.660	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
65	21.04.2023	FedEx Corp, Strike Price \$175 ±	90.513	0,00
200	20.01.2023	First Solar Inc, Strike Price \$55 ±	0	0,00
133	20.01.2023	First Solar Inc, Strike Price \$68 ±	0	0,00
106	20.01.2023	First Solar Inc, Strike Price \$80 ±	477	0,00
706	20.01.2023	FirstEnergy Corp, Strike Price \$30 ±	3.530	0,00
653	20.01.2023	FirstEnergy Corp, Strike Price \$32 ±	0	0,00
692	20.01.2023	FirstEnergy Corp, Strike Price \$37 ±	6.920	0,00
505	20.01.2023	FirstEnergy Corp, Strike Price \$45 ±	160.337	0,01
12	21.04.2023	Fluor Corp, Strike Price \$23 ±	300	0,00
136	21.04.2023	Fluor Corp, Strike Price \$30 ±	19.380	0,00
7.768	17.03.2023	Ford Motor Co, Strike Price \$11 ±	535.992	0,02
1.534	17.03.2023	Freenet AG, Strike Price EUR16 ±	22.102	0,00
838	17.03.2023	Freenet AG, Strike Price EUR19 ±	38.457	0,00
591	17.03.2023	Freenet AG, Strike Price EUR22 ±	114.796	0,00
42	16.06.2023	FTI Consulting Inc, Strike Price \$120 ±	11.760	0,00
23	16.06.2023	FTI Consulting Inc, Strike Price \$145 ±	15.755	0,00
16	16.06.2023	FTI Consulting Inc, Strike Price \$175 ±	34.080	0,00
34	21.04.2023	General Mills Inc, Strike Price \$55 ±	238	0,00
16	21.04.2023	General Mills Inc, Strike Price \$65 ±	560	0,00
50	16.06.2023	General Mills Inc, Strike Price \$70 ±	5.250	0,00
34	16.06.2023	General Mills Inc, Strike Price \$80 ±	10.880	0,00
1.600	16.06.2023	Glencore Plc, Strike Price GBP350 ±	116.465	0,00
233	21.04.2023	Guardant Health Inc, Strike Price \$18 ±	22.135	0,00
82	16.06.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$37 ±	27.880	0,00
432	17.03.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$42 ±	267.840	0,01
66	16.06.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$42 ±	43.560	0,00
3	17.03.2023	Halozyme Therapeutics Inc, Strike Price \$30 ±	0	0,00
896	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,600 ±	843.772	0,03
8.136	16.06.2023	Herbalife Nutrition Ltd, Strike Price \$10 ±	752.580	0,02
193	20.01.2023	Hess Corp, Strike Price \$75 ±	0	0,00
114	20.01.2023	Hess Corp, Strike Price \$105 ±	1.140	0,00
136	20.01.2023	Hess Corp, Strike Price \$90 ±	5.440	0,00
58	20.01.2023	Humana Inc, Strike Price \$300 ±	0	0,00
36	20.01.2023	Humana Inc, Strike Price \$365 ±	0	0,00
28	20.01.2023	Humana Inc, Strike Price \$430 ±	1.610	0,00
3.834	16.06.2023	Idorsia Ltd, Strike Price CHF10 ±	499.348	0,02
2.710	16.06.2023	Idorsia Ltd, Strike Price CHF9 ±	285.370	0,01
477	13.03.2023	IMM Euro Index Future, Strike Price \$94 ±	14.906	0,00
15.697	16.06.2023	ING Groep NV, Strike Price EUR7 ±	146.669	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
465	17.03.2023	Insulet Corp, Strike Price \$210 ±	146.475	0,01
1.940	16.06.2023	International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP100 ±	175.022	0,01
1.200	15.09.2023	International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP100 ±	151.565	0,01
8.333	17.03.2023	International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP80 ±	150.356	0,01
25	21.04.2023	Interpublic Group of Cos Inc, Strike Price \$31 ±	3.188	0,00
16.400	15.09.2023	Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1 ±	819.990	0,03
2.128	16.06.2023	iQIYI Inc, Strike Price \$2 ±	75.544	0,00
1	16.06.2023	ITT Inc, Strike Price \$70 ±	280	0,00
28	16.06.2023	ITT Inc, Strike Price \$85 ±	23.380	0,00
3	21.04.2023	JM Smucker Co, Strike Price \$120 ±	113	0,00
6	21.04.2023	JM Smucker Co, Strike Price \$140 ±	1.065	0,00
63	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$125 ±	3.339	0,00
27	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$150 ±	4.779	0,00
15	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$175 ±	10.950	0,00
3.599	15.09.2023	Just Eat Takeaway.com NV, Strike Price EUR13 ±	416.752	0,01
587	17.03.2023	Kellogg Co, Strike Price \$55 ±	0	0,00
307	17.03.2023	Kellogg Co, Strike Price \$65 ±	26.095	0,00
219	17.03.2023	Kellogg Co, Strike Price \$75 ±	106.215	0,00
2.159	20.01.2023	KeyCorp, Strike Price \$12 ±	0	0,00
1.778	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$13 ±	17.780	0,00
3.233	20.01.2023	KeyCorp, Strike Price \$15 ±	16.165	0,00
928	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$16 ±	48.720	0,00
2.508	20.01.2023	KeyCorp, Strike Price \$17 ±	87.780	0,00
693	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$19 ±	138.600	0,01
1.245	20.01.2023	KeyCorp, Strike Price \$20 ±	320.587	0,01
38	16.06.2023	Keysight Technologies Inc, Strike Price \$125 ±	9.880	0,00
22	16.06.2023	Keysight Technologies Inc, Strike Price \$150 ±	12.650	0,00
314	20.01.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$90 ±	0	0,00
146	20.01.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$110 ±	1.095	0,00
34	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$110 ±	4.760	0,00
98	20.01.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$130 ±	6.615	0,00
21	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$130 ±	11.340	0,00
78	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$90 ±	2.925	0,00
21	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW290 ±	12.622	0,00
15	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW298 ±	22.183	0,00
96	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW300 ±	179.359	0,01
85	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW305 ±	232.750	0,01
45	17.03.2023	Kr1 Plc, Strike Price EUR400 ∞	42.157	0,00
31	17.03.2023	Kr1 Plc, Strike Price EUR460 ∞	71.744	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
24	17.03.2023	Kr1 Plc, Strike Price EUR550 <sup>∞</sup>	203.283	0,01
75	21.04.2023	Kraft Heinz Co, Strike Price \$25 <sup>±</sup>	375	0,00
37	21.04.2023	Kroger Co, Strike Price \$35 <sup>±</sup>	1.443	0,00
23	21.04.2023	Kroger Co, Strike Price \$40 <sup>±</sup>	2.737	0,00
16	21.04.2023	Kroger Co, Strike Price \$47 <sup>±</sup>	6.560	0,00
23.499	16.06.2023	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24 <sup>±</sup>	56.534	0,00
12.800	15.09.2023	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24 <sup>±</sup>	46.191	0,00
7.969	20.01.2023	Luminar Technologies Inc, Strike Price \$5 <sup>±</sup>	338.682	0,01
738	17.03.2023	Lyft Inc, Strike Price \$10 <sup>±</sup>	80.811	0,00
30	21.04.2023	Lyft Inc, Strike Price \$13 <sup>±</sup>	7.950	0,00
5.064	21.04.2023	Lyft Inc, Strike Price \$8 <sup>±</sup>	230.412	0,01
372	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$60 <sup>±</sup>	13.950	0,00
194	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$75 <sup>±</sup>	43.165	0,00
146	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$90 <sup>±</sup>	135.780	0,00
22	16.06.2023	M&T Bank Corp, Strike Price \$145 <sup>±</sup>	26.510	0,00
16	16.06.2023	M&T Bank Corp, Strike Price \$170 <sup>±</sup>	43.440	0,00
151	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$21 <sup>±</sup>	17.592	0,00
46	21.04.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$23 <sup>±</sup>	5.520	0,00
105	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$26 <sup>±</sup>	30.345	0,00
29	21.04.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$28 <sup>±</sup>	9.425	0,00
94	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$30 <sup>±</sup>	47.705	0,00
24	21.04.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$32 <sup>±</sup>	14.220	0,00
1.206	21.07.2023	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$100 <sup>±</sup>	488.430	0,02
1.010	20.01.2023	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$85 <sup>±</sup>	60.600	0,00
257	21.04.2023	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$85 <sup>±</sup>	18.633	0,00
1.962	17.03.2023	Match Group Inc, Strike Price \$35 <sup>±</sup>	385.533	0,01
161	17.03.2023	Match Group Inc, Strike Price \$40 <sup>±</sup>	60.778	0,00
50	17.03.2023	McDonalds Corp, Strike Price \$260 <sup>±</sup>	40.750	0,00
344	20.01.2023	Merck & Co Inc, Strike Price \$63 <sup>±</sup>	344	0,00
189	20.01.2023	Merck & Co Inc, Strike Price \$75 <sup>±</sup>	567	0,00
138	20.01.2023	Merck & Co Inc, Strike Price \$88 <sup>±</sup>	138	0,00
298	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$55 <sup>±</sup>	8.195	0,00
202	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$65 <sup>±</sup>	23.230	0,00
545	17.03.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$40 <sup>±</sup>	47.142	0,00
317	20.01.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$50 <sup>±</sup>	63.241	0,00
341	17.03.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$50 <sup>±</sup>	128.727	0,00
288	17.03.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$58 <sup>±</sup>	245.520	0,01
221	20.01.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$60 <sup>±</sup>	221.552	0,01
182	20.01.2023	Micron Technology Inc, Strike Price \$73 <sup>±</sup>	409.500	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
65	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$245 ±	105.300	0,00
28	20.01.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$255 ±	46.130	0,00
46	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$290 ±	232.300	0,01
2.112	17.03.2023	Middleby Corp, Strike Price \$105 ±	438.240	0,01
100	16.06.2023	Middleby Corp, Strike Price \$105 ±	34.750	0,00
1.225	17.03.2023	Middleby Corp, Strike Price \$95 ±	131.688	0,00
1	21.04.2023	Molson Coors Beverage Co, Strike Price \$43 ±	58	0,00
15	21.04.2023	Molson Coors Beverage Co, Strike Price \$50 ±	3.375	0,00
438	17.03.2023	Morgan Stanley, Strike Price \$60 ±	14.892	0,00
256	17.03.2023	Morgan Stanley, Strike Price \$73 ±	33.664	0,00
189	17.03.2023	Morgan Stanley, Strike Price \$88 ±	116.707	0,00
250	17.02.2023	MP Materials Corp, Strike Price \$25 ±	65.000	0,00
19.674	16.06.2023	Natwest Group Plc, Strike Price GBP121 ±	58.869	0,00
203	17.03.2023	Neoen SA, Strike Price EUR28 ±	10.941	0,00
960	16.03.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR5 ±	12.039	0,00
14.020	16.03.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR6 ±	235.665	0,01
2.375	17.03.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR6 ±	223.324	0,01
2.500	15.09.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR6 ±	629.677	0,02
950	17.03.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR7 ±	177.937	0,01
1.326	21.07.2023	NextEra Energy Inc, Strike Price \$55 ±	222.105	0,01
153	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,875 ±	2.081.435	0,07
6	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,000 ±	87.082	0,00
4	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,125 ±	61.844	0,00
684	21.04.2023	NiSource Inc, Strike Price \$23 ±	15.390	0,00
478	21.04.2023	NiSource Inc, Strike Price \$25 ±	21.510	0,00
361	20.01.2023	NortonLifeLock Inc, Strike Price \$27 ±	216.600	0,01
88	16.06.2023	Ocado Group Plc, Strike Price GBP400 ±	56.897	0,00
1.050	17.02.2023	Ocado Group Plc, Strike Price GBP550 ±	606.262	0,02
787	17.02.2023	Okta Inc, Strike Price \$65 ±	356.118	0,01
756	17.03.2023	Omega Healthcare Investors Inc, Strike Price \$26 ±	68.040	0,00
525	17.03.2023	Omega Healthcare Investors Inc, Strike Price \$31 ±	196.875	0,01
750	16.06.2023	Ormat Technologies Inc, Strike Price \$65 ±	127.500	0,00
750.000	21.11.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$136 ±	19.825.274	0,63
59	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$125 ±	3.983	0,00
25	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$155 ±	6.450	0,00
15	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$180 ±	13.200	0,00
280	20.01.2023	PPL Corporation, Strike Price \$23 ±	1.400	0,00
180	20.01.2023	PPL Corporation, Strike Price \$30 ±	17.100	0,00
347	17.03.2023	Prudential Financial Inc, Strike Price \$70 ±	16.482	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
219	17.03.2023	Prudential Financial Inc, Strike Price \$83 ±	21.900	0,00
168	17.03.2023	Prudential Financial Inc, Strike Price \$98 ±	77.280	0,00
1.174	20.01.2023	PureCycle Technologies Inc, Strike Price \$5 ±	14.675	0,00
1.676	20.01.2023	PureCycle Technologies Inc, Strike Price \$6 ±	67.040	0,00
1.005	17.02.2023	PureCycle Technologies Inc, Strike Price \$6 ±	80.400	0,00
487	20.01.2023	Raytheon Technologies Corp, Strike Price \$65 ±	487	0,00
248	20.01.2023	Raytheon Technologies Corp, Strike Price \$80 ±	496	0,00
185	20.01.2023	Raytheon Technologies Corp, Strike Price \$90 ±	2.590	0,00
267	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$63 ±	56.737	0,00
178	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$75 ±	206.480	0,01
156	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,110 ±	6.630	0,00
810	31.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,550 ±	567.000	0,02
7	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,700 ±	8.750	0,00
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,820 ±	2.938	0,00
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,850 ±	3.550	0,00
18	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,860 ±	67.950	0,00
4	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,870 ±	16.050	0,00
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,910 ±	5.063	0,00
15	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,950 ±	93.938	0,00
850	17.02.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,950 ±	7.033.750	0,23
22	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,000 ±	176.000	0,01
8	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,050 ±	80.100	0,00
80	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,400 ±	18.200	0,00
363	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,500 ±	1.689.765	0,06
24	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,040 ±	593.880	0,02
20	16.06.2023	S&P Global Inc, Strike Price \$250 ±	8.300	0,00
11	16.06.2023	S&P Global Inc, Strike Price \$300 ±	13.310	0,00
8	16.06.2023	S&P Global Inc, Strike Price \$350 ±	25.360	0,00
870	17.03.2023	Safran SA, Strike Price EUR70 ±	34.355	0,00
212	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$120 ±	21.836	0,00
131	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$145 ±	171.937	0,01
96	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$175 ±	406.080	0,01
26	20.01.2023	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$40 ±	0	0,00
1.271.700	15.06.2023	Sasol Ltd, Strike Price ZAR22,500 ∞	1.352.305	0,05
560.000	15.06.2023	Sasol Ltd, Strike Price ZAR23,500 ∞	707.399	0,02
157	20.01.2023	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$65 ±	195.072	0,01
82	20.01.2023	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$80 ±	224.475	0,01
94	20.01.2023	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$95 ±	398.090	0,01
12.003	15.12.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR10 ±	634.105	0,02

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
32	16.06.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR14 ±	2.476	0,00
1.761	17.03.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR15 ±	90.213	0,00
801	15.12.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR8 ±	20.944	0,00
1.060	17.03.2023	Société Générale SA, Strike Price EUR16 ±	17.535	0,00
741	17.03.2023	Société Générale SA, Strike Price EUR19 ±	22.934	0,00
570	17.03.2023	Société Générale SA, Strike Price EUR23 ±	65.700	0,00
64	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$230 ±	75.840	0,00
47	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$280 ±	141.705	0,01
42	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$320 ±	224.490	0,01
65	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$70 ±	7.313	0,00
38	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$83 ±	10.336	0,00
28	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$98 ±	20.230	0,00
519	20.01.2023	STMicroelectronics, Strike Price \$30 ±	6.487	0,00
377	20.01.2023	STMicroelectronics, Strike Price \$35 ±	38.642	0,00
327	20.01.2023	STMicroelectronics, Strike Price \$40 ±	148.785	0,01
1.275	21.04.2023	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$13 ±	108.375	0,00
1.400	17.03.2023	Swiss Re AG, Strike Price CHF56 ±	27.237	0,00
400	15.09.2023	Swiss Re AG, Strike Price CHF60 ±	56.636	0,00
1	17.03.2023	TAG Immobilien AG, Strike Price EUR8 ±	174	0,00
106	17.03.2023	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$125 ±	231.345	0,01
172	17.03.2023	Texas Roadhouse Inc, Strike Price \$95 ±	130.720	0,00
14.791	17.03.2023	The Walt Disney Company, Strike Price \$10 ±	554.663	0,02
312.085	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price \$122 ∞	2.665.456	0,09
123.200	17.03.2023	TUI AG, Strike Price EUR1 ±	788.911	0,03
1.750	16.06.2023	UBS Group AG, Strike Price CHF11 ±	24.589	0,00
24.313	16.06.2023	UBS Group AG, Strike Price CHF9 ±	170.811	0,01
90	17.03.2023	Ulta Beauty Inc, Strike Price \$260 ±	4.275	0,00
55	17.03.2023	Ulta Beauty Inc, Strike Price \$320 ±	9.075	0,00
44	17.03.2023	Ulta Beauty Inc, Strike Price \$375 ±	20.240	0,00
666.400 USD	07.03.2024	United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price \$6 ∞	31.394	0,00
270.000 USD	20.03.2023	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price \$140 ∞	19.277	0,00
8.000.000 USD	03.02.2023	United States Dollar/Turkish Lira Currency Option, Strike Price \$19 ∞	107.214	0,00
638	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$21 ±	59.972	0,00
536	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$25 ±	130.248	0,00
87	16.06.2023	Unum Group, Strike Price \$35 ±	11.963	0,00
41	16.06.2023	Unum Group, Strike Price \$43 ±	17.630	0,00
432	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$40 ±	18.360	0,00
275	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$48 ±	72.875	0,00
210	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$58 ±	260.400	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 6,48 % (31. Dezember 2021: 9,75 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
19	16.06.2023	VeriSign Inc, Strike Price \$170 ±	7.030	0,00
14	16.06.2023	VeriSign Inc, Strike Price \$200 ±	17.290	0,00
250	16.06.2023	Viatis Inc, Strike Price \$11 ±	24.375	0,00
20	16.06.2023	Viatis Inc, Strike Price \$8 ±	350	0,00
362	16.06.2023	Viatis Inc, Strike Price \$9 ±	10.860	0,00
3.400	20.01.2023	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$4 ±	222.700	0,01
9.557	21.04.2023	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$4 ±	1.051.270	0,03
4.418	21.07.2023	Vishay Intertechnology Inc, Strike Price \$15 ±	209.855	0,01
38	16.06.2023	Wabtec Corp, Strike Price \$85 ±	9.215	0,00
484	20.01.2023	Walgreens Boots Alliance Inc, Strike Price \$33 ±	7.260	0,00
334	20.01.2023	Walgreens Boots Alliance Inc, Strike Price \$38 ±	45.090	0,00
278	20.01.2023	Walgreens Boots Alliance Inc, Strike Price \$43 ±	145.255	0,01
290	17.03.2023	Wells Fargo & Co, Strike Price \$45 ±	132.675	0,00
102	16.06.2023	Williams Companies Inc, Strike Price \$29 ±	11.985	0,00
83	16.06.2023	Williams Companies Inc, Strike Price \$34 ±	26.145	0,00
22	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$45 ±	5.225	0,00
4	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$55 ±	2.560	0,00
12	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$65 ±	16.080	0,00
240	20.01.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$50 ±	1.320	0,00
93	20.01.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$70 ±	4.138	0,00
105	20.01.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$83 ±	35.962	0,00
134	20.01.2023	XPO Logistics Inc, Strike Price \$65 ±	189.610	0,01
113	20.01.2023	XPO Logistics Inc, Strike Price \$75 ±	272.895	0,01
4.100	16.06.2023	ZTO Express Cayman Inc, Strike Price \$15 ±	0	0,00
4.367	16.06.2023	Zur Rose Group AG, Strike Price CHF18 ±	138.062	0,01
<b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: (390.939.728) US\$)</b>			<b>202.760.196</b>	<b>6,48</b>

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind BNP Paribas, Daiwa, Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Nomura International, SMBC Nikko Capital Markets Ltd und UBS AG.

### Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(4.903)	10X Genomics Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	519	0,00
(66.500)	10X Genomics Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(40.100)	1Life Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
49.900	3D Systems Corp	Morgan Stanley	0	0,00
14.679	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	875	0,00
253.459	3i Group Plc	JPMorgan Chase Bank	4.820	0,00
(90.555)	3M Co	Morgan Stanley	0	0,00
(526)	4imprint Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	426	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(157.626)	89Bio Inc	Morgan Stanley	95.706	0,01
(176.380)	89Bio Inc	JPMorgan Chase Bank	66.208	0,00
51.100	A10 Networks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.600	AAON Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.700	AAR Corp	Morgan Stanley	0	0,00
299.365	ABB Ltd	Goldman Sachs International	39.164	0,00
(4.800)	Abbott Laboratories	Morgan Stanley	0	0,00
52.841	AbbVie Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.026.605	AbbVie Inc	JPMorgan Chase Bank	1.271	0,00
28.500	AbCellera Biologics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.100	Abercrombie & Fitch Co - Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(17.600)	ABM Industries Inc	Morgan Stanley	21.597	0,00
229.857	abrdn Plc	Bank of America Merrill Lynch	24.652	0,00
(16.632.176)	Absa Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	90.990	0,00
(4.754.771)	Academy Sports & Outdoors Inc	Morgan Stanley	200.140	0,01
(9.400)	Acadia Healthcare Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(218.825)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	19.299	0,00
63.900	Acadia Realty Trust	Morgan Stanley	0	0,00
452.487	Accelleron Industries AG	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.100)	Accenture Plc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.035.315)	Acciona SA	Goldman Sachs International	0	0,00
3.950.755	Accor SA	Société Générale	3.209	0,00
197.127	Accor SA	JPMorgan Chase Bank	6.320	0,00
241.274	Accor SA	Goldman Sachs International	6.254	0,00
(58.100)	ACI Worldwide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.800)	Aclaris Therapeutics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.300	Activision Blizzard Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.570.601)	Activision Blizzard Inc	JPMorgan Chase Bank	2.048	0,00
4.500	Acuity Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
864.303	Acushnet Holdings Corp	Morgan Stanley	37.379	0,00
(78.120)	ACV Auctions Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
45.900	AdaptHealth Corp	Morgan Stanley	0	0,00
73.700	Adaptive Biotechnologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.600	Addus HomeCare Corp	Morgan Stanley	0	0,00
97.765	Adecco Group AG	JPMorgan Chase Bank	11.621	0,00
202.950	Adecco Group AG	Morgan Stanley	13.744	0,00
46.600	Adecoagro SA	Morgan Stanley	0	0,00
74.000	Adient Plc	Morgan Stanley	0	0,00
3.020	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.329	0,00
(2.096.727)	Adobe Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.090)	ADT Inc	Morgan Stanley	0	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(21.100)	Adtalem Global Education Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.300)	ADTRAN Inc	Morgan Stanley	9.463	0,00
21.600	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.000	Advanced Drainage Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.300	Advanced Energy Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
476.935	Advanced Micro Devices Inc	JPMorgan Chase Bank	77.671	0,00
194.831	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	14.522	0,00
(2.916.828)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs International	21.056	0,00
12.100	AdvanSix Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.597.722	Advantest Corp	Goldman Sachs International	6.173	0,00
10.111.693	Advantest Corp	Morgan Stanley	5.948	0,00
21.818	Adyen NV	JPMorgan Chase Bank	1.156	0,00
162.560	Adyen NV	Morgan Stanley	24.125	0,00
6.731	Adyen NV	Goldman Sachs International	268	0,00
9.472	AEA-Bridges Impact Corp	Morgan Stanley	2.604	0,00
302.568	AECOM	Goldman Sachs International	0	0,00
2.400	Aeon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	502	0,00
8.700	AEON Financial Service Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	414	0,00
16.500	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	0	0,00
199.036	AeroVironment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.300)	AeroVironment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.900	AES Corp	Morgan Stanley	644	0,00
(100)	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(107.437)	Affirm Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(42.600)	Aflac Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.400)	AGC Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.906	0,00
(7.800)	AGCO Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.700	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(71.900)	agilon health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.100)	Agilysys Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(47.700)	AGNC Investment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(18.700)	Agree Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
241.558.800	Aica Kogyo Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(3.300)	Aica Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	570	0,00
14.900	Aiful Corp	Bank of America Merrill Lynch	956	0,00
3.200	Ain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.467	0,00
37.600	Air Lease Corp	Morgan Stanley	0	0,00
41.185	Air Liquide SA	Goldman Sachs International	8.535	0,00
(7.600)	Air Products & Chemicals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
37.300	Air Transport Services Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.800	Air Water Inc	Bank of America Merrill Lynch	748	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
635.535	Airbnb Inc Class A	Morgan Stanley	32.167	0,00
(602.714)	Airbus SE	JPMorgan Chase Bank	56.345	0,00
151.452	Airbus SE1	Goldman Sachs International	9.233	0,00
(151.306)	Airtel Africa Plc	Bank of America Merrill Lynch	10.051	0,00
41.241	AJ Bell Plc	Bank of America Merrill Lynch	27	0,00
(3.200)	Ajinomoto Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.909	0,00
7.230.773	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
75.627	Akzo Nobel NV	Morgan Stanley	6.308	0,00
60.634	Akzo Nobel NV	JPMorgan Chase Bank	7.238	0,00
329.671	Akzo Nobel NV	Goldman Sachs International	24.247	0,00
(200)	Alamo Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.300	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.400)	Alaska Air Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.700	Albany International Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
11.696	Albemarle Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.900)	Albertsons Cos Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(34.100)	Alcoa Corp	Morgan Stanley	0	0,00
22.800	Alexander & Baldwin Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.400	Alexandria Real Estate Equities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
449.709	Alfa Laval AB	Morgan Stanley	32.476	0,00
(2.255.342)	Alibaba Group Holding Ltd	JPMorgan Chase Bank	327.486	0,01
(7.901.239)	Alibaba Group Holding Ltd	Goldman Sachs International	116.441	0,01
(3.469.160)	Alibaba Group Holding Ltd	Morgan Stanley	125.044	0,00
(61.499)	Alight Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(499.271)	Align Technology Inc	Goldman Sachs International	7.007	0,00
(1.000)	Align Technology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
55.300	Alignment Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	0	0,00
(12.886)	Allegion Plc	Morgan Stanley	0	0,00
58.641	Allegro MicroSystems Inc	JPMorgan Chase Bank	3.503	0,00
25.200	Allegro MicroSystems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(15.200)	ALLETE Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.000)	AllianceBernstein Holding LP	Morgan Stanley	0	0,00
1.300	Alliant Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
65.800	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(45.000)	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
176.595	Allstate Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
11.040	Allstate Corp	Morgan Stanley	7.709	0,00
18.100	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(926.984)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	126.818	0,01
1.000	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
500	Alpha Metallurgical Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.985.296	Alphabet Inc Class A	Morgan Stanley	50.442	0,00
1.182.555	Alphabet Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	21.349	0,00
328.553	Alphabet Inc Class A	Goldman Sachs International	24.818	0,00
(237.447)	Alphabet Inc Class C	Morgan Stanley	477	0,00
5.800	Alphatec Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.100)	Alps Alpine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.287	0,00
(15.200)	Altair Engineering Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
8.100	Alteryx Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(19.600)	Altra Industrial Motion Corp	Morgan Stanley	0	0,00
118.900	Altus Power Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.500	Amada Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	391	0,00
(633.483)	Amazon.com Inc	Goldman Sachs International	3.957	0,00
334.570	Amazon.com Inc	Morgan Stanley	11.036	0,00
(14.300)	Ambarella Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(118.800)	Amcor Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
503.671	Amedisys Inc	Goldman Sachs International	26.590	0,00
6.300	Amedisys Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.400	Ameren Corp	Morgan Stanley	2.620	0,00
1.926.900	Ameresco Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	202.897	0,01
1.098.068	Ameresco Inc Class A	Goldman Sachs International	150.368	0,01
519.756	Ameresco Inc Class A	Morgan Stanley	50.401	0,00
24.874.114	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs International	20.298	0,00
15.700	American Assets Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
111.900	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.300	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.100	American Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.892)	American Equity Investment Life Holding Co	Morgan Stanley	0	0,00
8.200	American Express Co	Morgan Stanley	0	0,00
6.900	American Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
33.600	American Homes 4 Rent Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(36.700)	American International Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.100)	American States Water Co	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	American Tower Corp	Morgan Stanley	0	0,00
176.568	American Water Works Co Inc	JPMorgan Chase Bank	4.706	0,00
8.310	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	14	0,00
(15.800)	Americold Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.400	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.100	Ameris Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.000)	AmerisourceBergen Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
519.062	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs International	113.217	0,01
(4.859.269)	AmerisourceBergen Corp	JPMorgan Chase Bank	152.691	0,01
39.537	AMETEK Inc	Morgan Stanley	0	0,00
423.334	Amgen Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
85.685	Amgen Inc	Morgan Stanley	24.200	0,00
2.840.476	Amgen Inc	JPMorgan Chase Bank	194.772	0,01
1.300	Amkor Technology Inc	Morgan Stanley	9.009	0,00
6.335	AMN Healthcare Services Inc	JPMorgan Chase Bank	531	0,00
1.633.877	AMN Healthcare Services Inc	Goldman Sachs International	233.241	0,01
500	AMN Healthcare Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.700	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
32.900	Amphenol Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(12.161)	Amplitude Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
3.340.899	ams AG	Société Générale	0	0,00
(6.390.001)	ams AG	Goldman Sachs International	0	0,00
34.600.000	ams-OSRAM AG	Société Générale	230.731	0,01
7.600	Amylyx Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.724.341.700	ANA Holdings Inc	Société Générale	18.160	0,00
3.100	ANA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	423	0,00
(244.764)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs International	21.790	0,00
(1.025.123)	Analog Devices Inc	JPMorgan Chase Bank	134.347	0,00
(21.300)	Andersons Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(389.646)	Anglo American Plc	Goldman Sachs International	45.826	0,00
(142.146)	Anglo American Plc	JPMorgan Chase Bank	12.381	0,00
(141.300)	Annaly Capital Management Inc	Morgan Stanley	87.896	0,00
(900)	ANSYS Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(22.400)	Antero Midstream Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.500	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
76.100	Anywhere Real Estate Inc	Morgan Stanley	0	0,00
67.165	AO Smith Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.200)	Aon Plc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
14.200	Aozora Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.439	0,00
(966.343)	AP Moller - Maersk A/S Class B	Morgan Stanley	46.025	0,00
(22.300)	APA Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(70.700)	Apartment Income REIT Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(102)	Apartment Investment & Management Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00
143.712	Apellis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.300)	API Group Corp	Morgan Stanley	0	0,00
11.700	Apogee Enterprises Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.500	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.245)	Apollo Global Management Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
900	Apollo Medical Holdings Inc	Morgan Stanley	561	0,00
(884.600)	Apollo Strategic Growth Capital II	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Appfolio Inc - Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(14.100)	Appian Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(4.100)	Apple Hospitality REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.751.389	Apple Inc	Goldman Sachs International	171.867	0,01
11.416.047	Apple Inc	Morgan Stanley	896.001	0,03
7.613.289	Apple Inc	JPMorgan Chase Bank	906.093	0,03
(6.200)	Applied Industrial Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
198.433	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	8.136	0,00
458.789	Applied Materials Inc	Goldman Sachs International	17.754	0,00
(8.400)	AppLovin Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.052.320	Aptiv Plc	Morgan Stanley	7.976	0,00
(822.322)	Aramark	Morgan Stanley	48.351	0,00
(29.900)	Arbor Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.769	ArcBest Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.779.750)	ArcelorMittal SA	Morgan Stanley	24.955	0,00
137.531	ArcelorMittal SA	JPMorgan Chase Bank	21.332	0,00
288.513	ArcelorMittal SA	Goldman Sachs International	187	0,00
(700)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(10.000)	Arch Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.600)	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	0	0,00
49.900	Archrock Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.525	Arconic Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(92.600)	Arcos Dorados Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.100	Arcosa Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.079	Ares Acquisition Corp	Morgan Stanley	6.098	0,00
(7.400)	Ares Management Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(693.573)	Argenx SE	JPMorgan Chase Bank	82.490	0,00
(397.794)	Argenx SE	Goldman Sachs International	81.294	0,00
(900)	Argo Group International Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
12.957	Arista Networks Inc	JPMorgan Chase Bank	8.259	0,00
61.080	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	588	0,00
21.800	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.250	Arqit Quantum Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(81.980)	Array Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	5.435	0,00
(66.706)	Array Technologies Inc	Goldman Sachs International	6.871	0,00
41.500	Array Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(200)	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
32.000	Artisan Partners Asset Management Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(319.357)	Arvinas Inc	Morgan Stanley	9.162	0,00
1.000	As One Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.726	0,00
(3.100)	Asahi Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	542	0,00
(32.400)	Asana Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.600)	Asbury Automotive Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
29.684	Ascential Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.295	0,00
16.600	ASGN Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.100	Ashland Inc	Morgan Stanley	0	0,00
49.910	Ashmore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	19.587	0,00
(566.002)	Ashtead Group Plc	JPMorgan Chase Bank	46.749	0,00
(1.483.951)	Ashtead Group Plc	Goldman Sachs International	114.784	0,01
(63.414)	ASML Holding NV	Goldman Sachs International	398	0,00
(245.757)	ASML Holding NV	Morgan Stanley	13.853	0,00
(212.066)	ASML Holding NV	JPMorgan Chase Bank	459	0,00
(7.336)	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.200	Associated Banc-Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.054)	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	6.489	0,00
(154.180)	Associated British Foods Plc	JPMorgan Chase Bank	42.311	0,00
1.100	Assurant Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.800)	Assured Guaranty Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
1.200	Astec Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.800)	Astellas Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	653	0,00
(2.640.108)	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs International	488.804	0,02
(202.046)	AstraZeneca Plc	Morgan Stanley	9.309	0,00
(453.513)	AstraZeneca Plc	JPMorgan Chase Bank	31.722	0,00
(139.136)	AT&T Inc	Morgan Stanley	224	0,00
(1.220.946)	AT&T Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
225	Athena Pubco BV	Goldman Sachs International	0	0,00
4.155	Athena Pubco BV	Morgan Stanley	415	0,00
(12.900)	ATI Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.400	Atkore Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.100	Atlantic Union Bankshares Corp	Morgan Stanley	0	0,00
25.000	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(256.328)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	4.549	0,00
(6.300)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.617.004	Atlas Copco AB Class A	JPMorgan Chase Bank	6.254	0,00
7.848.178	Atlas Copco AB Class A	Morgan Stanley	11.094	0,00
(324.347)	Atlassian Corp Class A	Morgan Stanley	11.451	0,00
(6.600)	Atlassian Corp Plc Class A	Morgan Stanley	78.300	0,00
(9.100)	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(2.300)	AtriCure Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.167)	Auction Technology Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	658	0,00
(24)	Aurora Innovation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(314.818)	Auto Trader Group Plc	Goldman Sachs International	23.540	0,00
5.900	Autobacs Seven Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	719	0,00
18.000	Autodesk Inc	Morgan Stanley	0	0,00
310.267	Autohome Inc	Morgan Stanley	12.462	0,00
1.294.965	Autoliv Inc	Morgan Stanley	143.928	0,01
630.768	Autoliv Inc	JPMorgan Chase Bank	30.587	0,00
1.100.182	Autoliv Inc	Goldman Sachs International	31.935	0,00
582.635	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	12.040	0,00
(4.500)	AutoNation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
400	AutoZone Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.900	AvalonBay Communities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.800)	Avangrid Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.700	Avanos Medical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.700	Avantor Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.300)	Avid Technology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(46.221)	Avidity Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	8.619	0,00
(362.361)	Avidity Biosciences Inc	Morgan Stanley	106.891	0,01
(373.041)	Avidity Biosciences Inc	Goldman Sachs International	226.912	0,01
(23.500)	AvidXchange Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.000)	Avient Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.000)	Avis Budget Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(15.500)	Avista Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(40.000)	Avnet Inc	Morgan Stanley	0	0,00
24.000	Axalta Coating Systems Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	Axcelis Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
157.395	Axfood AB	JPMorgan Chase Bank	1.916	0,00
5.196.751	Axfood AB	Goldman Sachs International	105	0,00
13.700	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
112.317	Axon Enterprise Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.100	Axonics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.200	Axos Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
101.592	Axsome Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3.989	0,00
(34.000)	AZEK Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(28.400)	Azenta Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.900	AZZ Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.200)	B Riley Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(63.100)	B&G Foods Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(40.696)	Babcock International Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.002	0,00
(1.400)	Badger Meter Inc	Morgan Stanley	0	0,00
44.530	BAE Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	50.897	0,00
(1.430.681)	BAE Systems Plc	Goldman Sachs International	28.768	0,00
(838.889)	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	36.589	0,00
(251.218)	Baker Hughes Co	JPMorgan Chase Bank	3.384	0,00
6.300	Balchem Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.200	Ball Corp	Morgan Stanley	0	0,00
28.400	Bally's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.500	Banc of California Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	BancFirst Corp	Morgan Stanley	0	0,00
13.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Société Générale	1.752.694	0,07
6.500.000	Banco BPM SpA	Société Générale	185.249	0,01
(21.000)	Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
74.505.912	Bandai Namco Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	66.946	0,00
32.262.328	Bandai Namco Holdings Inc	Morgan Stanley	17.701	0,00
44.772.209	Bandai Namco Holdings Inc	Goldman Sachs International	30.608	0,00
855.769	Bank of America Corp	Morgan Stanley	26.730	0,00
(10.600)	Bank of Hawaii Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	Bank of Kyoto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13.111	0,00
89.200	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
18.200	Bank OZK	Morgan Stanley	0	0,00
(1.193.466)	Bank Pekao SA	Morgan Stanley	1.067	0,00
(1.458.592)	Bank Pekao SA	Goldman Sachs International	38.054	0,00
(3.303)	BankUnited Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.300	Banner Corp	Morgan Stanley	0	0,00
312.820	Barclays Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.742	0,00
(10.600)	Barnes Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(399.711)	Barratt Developments Plc	Goldman Sachs International	8.279	0,00
(171.342)	BASF SE	Morgan Stanley	71.669	0,00
(31.500)	Bath & Body Works Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(55.600)	Bausch + Lomb Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(300.700)	Bausch Health Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(79.413)	Baxter International Inc	Goldman Sachs International	339	0,00
(17.700)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(708.271)	Baxter International Inc	JPMorgan Chase Bank	9.498	0,00
(4.100)	BayCurrent Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.772	0,00
505.381	Bayerische Motoren Werke AG	Morgan Stanley	61.871	0,00
(112.282)	BE Semiconductor Industries NV	Goldman Sachs International	21.815	0,00
(4.000)	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	0	0,00
701.148	Beam Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	54.192	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
120.250	Beam Therapeutics Inc	Morgan Stanley	11.865	0,00
4.800	Beauty Health Co	Morgan Stanley	0	0,00
(827.719)	Beazley Plc	Morgan Stanley	120.015	0,01
(186.421)	Beazley Plc	JPMorgan Chase Bank	23.139	0,00
(343.208)	Beazley Plc	Goldman Sachs International	90.343	0,00
1.215.187	Becton Dickinson and Co	JPMorgan Chase Bank	2.387	0,00
(14.400)	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	0	0,00
(25.759)	Beiersdorf AG	Morgan Stanley	12.337	0,00
400	Belden Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(331.563)	BellRing Brands Inc	Morgan Stanley	29.922	0,00
(1.035.919)	BellRing Brands Inc	Goldman Sachs International	51.444	0,00
(2.879)	Bellway Plc	Bank of America Merrill Lynch	755	0,00
400	Benefit One Inc	Bank of America Merrill Lynch	71	0,00
(78.800)	Bentley Systems Inc Class B	Morgan Stanley	0	0,00
(66.414)	Berkeley Group Holdings Plc	Goldman Sachs International	4.826	0,00
(4.300)	Berkshire Hathaway Inc Class B	Morgan Stanley	0	0,00
15.900	Berkshire Hills Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.000	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.709.500	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	57.708	0,00
1.821.058	Best Buy Co Inc	JPMorgan Chase Bank	76.379	0,00
(6.500)	Beyond Meat Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(79.057)	Bicycle Therapeutics Plc	Goldman Sachs International	13.407	0,00
(477.039)	Bicycle Therapeutics Plc	JPMorgan Chase Bank	92.816	0,00
103.200	BigCommerce Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.200	Bill.com Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.478	BioLife Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
537.137	Bio-Rad Laboratories Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.868	0,00
(1.000)	Bio-Rad Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	Bio-Techne Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.821.821	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	1.902	0,00
26.300	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.600)	Black Hills Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.600	Black Knight Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.800)	Black Stone Minerals LP	Morgan Stanley	0	0,00
(5.000)	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.400)	Blackline Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.600)	BlackRock Inc	Morgan Stanley	0	0,00
59.900	Blackstone Mortgage Trust Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
22.600	Blackstone Secured Lending Fund	Morgan Stanley	0	0,00
(39.800)	Blackstone Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(30.400)	Blink Charging Co	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(43.529)	Block Inc	Morgan Stanley	1.156	0,00
(600)	Bloom Energy Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
371.914	Bloomin' Brands Inc	Morgan Stanley	14.954	0,00
(11.100)	Blucora Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(119.600)	Blue Owl Capital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(337.673)	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs International	3.951	0,00
69.721	Blueprint Medicines Corp	Morgan Stanley	4.350	0,00
653.204	Blueprint Medicines Corp	JPMorgan Chase Bank	143.979	0,01
26.729	Bluescape Opportunities Acquisition	Morgan Stanley	4.274	0,00
86.952	BNP Paribas SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(428.819)	Bodycote Plc	Goldman Sachs International	1.159	0,00
(33.599)	Boeing Co	Morgan Stanley	0	0,00
(11.369.400)	Boeing Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.700)	Boise Cascade Co	Morgan Stanley	0	0,00
1.300	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(144.393)	boohoo Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	10.089	0,00
10.400.000	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs International	1.455.175	0,05
(3.200)	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.400)	Boot Barn Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
53.854	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(158.570)	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	0	0,00
900	Boston Beer Co Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.402.129)	Boston Properties Inc	Goldman Sachs International	2.376	0,00
2.100	Boston Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.873.957)	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs International	124.456	0,01
(50.500)	Boston Scientific Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(901.701)	Boston Scientific Corp	JPMorgan Chase Bank	13.884	0,00
(10.400)	Bowlero Corp	Morgan Stanley	0	0,00
33.700	Box Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
37.600	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	0	0,00
266.477	BP Plc	Bank of America Merrill Lynch	28.729	0,00
(1.400)	Brady Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
86.200	Brandywine Realty Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(15.000)	Braze Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
3.100	Bread Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(88.202)	Brenntag SE	Morgan Stanley	13.402	0,00
45.549	Bridgepoint Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.907	0,00
11.200	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.100)	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(410.336)	Brightsphere Investment Group Inc	JPMorgan Chase Bank	66.594	0,00
(239.432)	Brightsphere Investment Group Inc	Goldman Sachs International	40.444	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
29.500	BrightSpire Capital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
742.087	Brinker International Inc	Morgan Stanley	16.506	0,00
(26.200)	Brinker International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.100	Brink's Co	Morgan Stanley	0	0,00
3.741.454	Bristol-Myers Squibb Co	Morgan Stanley	49.692	0,00
463.142	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs International	10.197	0,00
(5.764)	Britvic Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.917	0,00
937.045	Broadcom Inc	Goldman Sachs International	36.782	0,00
114.243	Broadcom Inc	JPMorgan Chase Bank	82.430	0,00
(1.211.110)	Broadcom Inc	Morgan Stanley	50.857	0,00
(25.300)	Broadmark Realty Capital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(900)	Broadridge Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.500)	Broadstone Net Lease Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14)	Brookfield Asset Management Ltd Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(56)	Brookfield Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.225)	Brookfield Property Preferred LP Class A	Morgan Stanley	0	0,00
34.600	Brookfield Renewable Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
47.100	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	0	0,00
161.891	Brown-Forman Corp Class B	JPMorgan Chase Bank	5.430	0,00
130.928	Brown-Forman Corp Class B	Morgan Stanley	10.518	0,00
839.831	Brown-Forman Corp Class B	Goldman Sachs International	86.309	0,00
(19.333)	BRP Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
4.500	Bruker Corp	Morgan Stanley	0	0,00
96.748	Brunswick Corp	Morgan Stanley	1.145	0,00
(18.300)	Buckle Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(22.012)	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(20.400)	Bumble Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(15.400)	Bunge Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(5.560.130)	Burlington Stores Inc	JPMorgan Chase Bank	363.946	0,01
(2.114.254)	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	87.339	0,00
(4.117.445)	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs International	103.979	0,01
11.600	BWX Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.980)	Bytes Technology Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	229	0,00
600	C Uyemura & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.169	0,00
34.241	C&C Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.421	0,00
62.200	C3ai Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Cable One Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.700)	Cabot Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.900	Cactus Inc- Class A	Morgan Stanley	0	0,00
4.370	Cadence Bank	Morgan Stanley	0	0,00
81.728	Cadence Design Systems Inc	JPMorgan Chase Bank	1.748	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
222.038	Cadence Design Systems Inc	Morgan Stanley	2.545	0,00
27.500	Caesars Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.400)	Caleres Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(212.620)	California Resources Corp	Morgan Stanley	10.371	0,00
(482.127)	California Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	16.303	0,00
(2.662.665)	California Resources Corp	Goldman Sachs International	155.706	0,01
173.523	California Water Service Group	JPMorgan Chase Bank	3.072	0,00
10.500	California Water Service Group	Morgan Stanley	0	0,00
10.100	Calix Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.300	Callon Petroleum Co	Morgan Stanley	0	0,00
(8.000)	Cal-Maine Foods Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(30.700)	Camden Property Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(6.700)	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	0	0,00
171.501	Camping World Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	32.314	0,00
(54.000)	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.359)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	0	0,00
33.454	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(7.600)	Canadian Solar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25.800	Cannae Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
204.221	Cano Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.404.633	Canon Inc	JPMorgan Chase Bank	3.123	0,00
10.823.062	Canon Inc	Goldman Sachs International	6.308	0,00
4.180.649	Canon Inc	Morgan Stanley	1.397	0,00
5.000	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.374	0,00
600	Capcom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	102	0,00
32.300	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(903.888)	Capitec Bank Holdings Ltd	Morgan Stanley	874	0,00
(15.500)	Capitol Federal Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.939.040)	Capri Holdings Ltd	Morgan Stanley	170.076	0,01
(2.583.429)	Capri Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	32.129	0,00
1.643	Cardinal Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
886.211	Cardinal Health Inc	JPMorgan Chase Bank	9.836	0,00
22.400	Carenet Inc	Bank of America Merrill Lynch	27.428	0,00
55.200	CareTrust REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
221.848	Cargotec OYJ Class B	Morgan Stanley	27.706	0,00
(76.000)	Cargurus Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	Carlisle Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(54.000)	Carlyle Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(15.400)	CarMax Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.321.286	Carnival Corp	Nomura	0	0,00
(145.575)	Carnival Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(43.309)	Carnival Plc	Bank of America Merrill Lynch	15.128	0,00
23.700	Carpenter Technology Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.565.883	Carrier Global Corp	JPMorgan Chase Bank	75.225	0,00
(137.436)	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	0	0,00
28.400	Cars.com Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.400)	Carter's Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(34.800)	Carvana Co	Morgan Stanley	0	0,00
4.900	Casella Waste Systems Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(29.300)	Cassava Sciences Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.100	Catalent Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.749)	CATCHA INVT Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(23.400)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.800	Cathay General Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	Cavco Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.100	CBIZ Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.200)	CBRE Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
24.900	CCC Intelligent Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
185.401	CDW Corp	Morgan Stanley	2.757	0,00
26.800.000	Cellnex Telecom SA	Société Générale	129.632	0,01
4.778.728	Cellnex Telecom SA	Goldman Sachs International	7.232	0,00
10.236	Cellnex Telecom SA	Morgan Stanley	779	0,00
77.105	Cellnex Telecom SA	JPMorgan Chase Bank	7.015	0,00
(3.000)	Celsius Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.065.971)	Centene Corp	Morgan Stanley	10.490	0,00
(1.542.428)	Centene Corp	JPMorgan Chase Bank	9.075	0,00
(810.748)	Centene Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
34.500	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.300	Centerspace	Morgan Stanley	0	0,00
864.386	Centerspace	Goldman Sachs International	69.232	0,00
2.100	Central Garden & Pet Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00
600	Central Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	3.645	0,00
412.842	Centrica Plc	Bank of America Merrill Lynch	61.809	0,00
(13.000)	Century Communities Inc	Morgan Stanley	3.337	0,00
(3.371)	Ceres Power Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	249	0,00
3.254.877	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
96.450	Certara Inc	Goldman Sachs International	243	0,00
(42.800)	Certara Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.160.569	CEZ AS	Morgan Stanley	30.658	0,00
25.087	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.300)	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
26.800	ChampionX Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(6.300)	Change Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.584	0,00
540.596	ChargePoint Holdings Inc	Goldman Sachs International	232.322	0,01
1.077.241	ChargePoint Holdings Inc	Morgan Stanley	13.114	0,00
1.267.382	ChargePoint Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	284.624	0,01
(800)	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
164.520	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.000)	Charles Schwab Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	Chart Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
23.628	Charter Communications Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.313	0,00
169.571	Charter Communications Inc Class A	Morgan Stanley	21.716	0,00
1.900	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
311.759	Cheesecake Factory Inc	Morgan Stanley	17.767	0,00
2.700	Chefs' Warehouse Inc	Morgan Stanley	0	0,00
89.100	Chegg Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(189.360)	Chemed Corp	JPMorgan Chase Bank	1.166	0,00
(400)	Chemed Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.600)	Chemours Co	Morgan Stanley	0	0,00
(24.705)	Chemring Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.471	0,00
787.166	Cheniere Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	73.946	0,00
157.227	Cheniere Energy Inc	Goldman Sachs International	7.522	0,00
862.004	Cheniere Energy Inc	Morgan Stanley	76.985	0,00
16.200	Chesapeake Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.700)	Chesapeake Utilities Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(41.576)	Chevron Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.100)	Chewy Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(88.554)	Chimera Investment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
988.937	Chipotle Mexican Grill Inc	Morgan Stanley	37.805	0,00
(10.700)	Chiyoda Corp	Bank of America Merrill Lynch	213	0,00
1.134.133	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	38.752	0,00
13.435	Chord Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.100)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.674	0,00
11.100	Chugin Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.011	0,00
67.900	Chugoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	23.575	0,00
(2.100)	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.134	Churchill Capital Corp	Morgan Stanley	1.381	0,00
(5.700)	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	0	0,00
75.692	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs International	4.136	0,00
(934.565)	Cie Financiere Richemont SA	JPMorgan Chase Bank	15.453	0,00
(557.444)	Ciena Corp	Morgan Stanley	15.395	0,00
2.620.918	Cigna Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(40.782)	Cigna Corp	JPMorgan Chase Bank	1.832	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(750.406)	Cigna Corp	Morgan Stanley	25.146	0,00
(16.800)	Cincinnati Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.600	CinCor Pharma Inc	Morgan Stanley	0	0,00
104.000	Cinemark Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.200)	Cintas Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.400)	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
267.760	Cisco Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(21.700)	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
659.230	Cisco Systems Inc	JPMorgan Chase Bank	12.986	0,00
(44.100)	Citigroup Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.302)	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.700)	City Holding Co	Morgan Stanley	0	0,00
(31.700)	Civitas Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
63.430	Clariant AG	Goldman Sachs International	2.384	0,00
(72.900)	Clarivate Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(21.200)	Claros Mortgage Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
67.260	Clean Energy Fuels Corp	Morgan Stanley	0	0,00
9.500	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.700	Clear Secure Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(8.300)	Clearfield Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.200)	Clearwater Analytics Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(20.200)	Clearway Energy Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(28.600)	Clearway Energy Inc Class C	Morgan Stanley	0	0,00
(1.163.591)	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(85.700)	Cleveland-Cliffs Inc	Morgan Stanley	0	0,00
91.354	Clorox Co	JPMorgan Chase Bank	2.461	0,00
6.712.026	Clorox Co	Morgan Stanley	131.214	0,00
375.351	Clorox Co	Goldman Sachs International	19.363	0,00
14.400	Cloudflare Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
34.200	CME Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
18.900	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(777.539)	CMS Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	18.290	0,00
20.000	CNA Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
49.800	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	0	0,00
28.900	CNO Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.200)	CNX Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
116.390	Coats Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	22.430	0,00
(89.100)	Coca-Cola Co	Morgan Stanley	0	0,00
32.900	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Morgan Stanley	0	0,00
33.658	Coca-Cola HBC AG	Bank of America Merrill Lynch	44.184	0,00
(4.200)	Cogent Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
17.800	Cognex Corp	Morgan Stanley	0	0,00
269.712	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
234.574	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Morgan Stanley	5.543	0,00
191.042	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	11.684	0,00
(9.900)	Cohen & Steers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.804	Coherent Corp	Morgan Stanley	0	0,00
28.800	Cohu Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(120.312)	Colgate-Palmolive Co	JPMorgan Chase Bank	3.841	0,00
(801.203)	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	41.867	0,00
(232.371)	Colgate-Palmolive Co	Goldman Sachs International	15.935	0,00
1.955	Colonnade Acquisition Corp II	Goldman Sachs International	0	0,00
(90.700)	Colonnade Acquisition Corp II Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(19.500)	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.800)	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	0	0,00
(100.230)	Comcast Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	41.425	0,00
(384.579)	Comcast Corp Class A	Morgan Stanley	6.049	0,00
(800)	Comerica Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.800	Comfort Systems USA Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.937)	Commerce Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.400)	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	0	0,00
(7.700)	CommScope Holding Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.400)	Community Bank System Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.700	CommVault Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(62.353)	Compass Group Plc	Goldman Sachs International	5.558	0,00
20.342	Compass Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	13.166	0,00
9.400	Compass Minerals International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.191	Compute Health Acquisition Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(910.000)	Compute Health Acquisition Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
886.210	Comstock Resources Inc	Morgan Stanley	142.010	0,01
54.289	Comstock Resources Inc	Goldman Sachs International	4.313	0,00
337.850	Comstock Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	17.291	0,00
(300)	COMSYS Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	72	0,00
(178.034)	Conagra Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	2.474	0,00
9.400	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.500)	Concentrix Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.166)	Confluent Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
82.929	Confluent Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	9.077	0,00
5.236	Confluent Inc Class A	Morgan Stanley	1.559	0,00
1.013.469	CONMED Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(19.000)	CONMED Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(557.102)	ConocoPhillips	Goldman Sachs International	3.094	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1.136.071)	ConocoPhillips	Morgan Stanley	13.659	0,00
(8.201)	Consensus Cloud Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.000)	Consolidated Edison Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(910.991)	Constellation Acquisition Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Constellation Brands Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(218.966)	Constellation Brands Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.862	0,00
32.333	Constellation Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
21.800	Constellation Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
42.300	Constellium SE	Morgan Stanley	0	0,00
(14.700)	Construction Partners Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(193.401)	Continental AG	Morgan Stanley	59.624	0,00
523.074	Cooper Cos Inc	Morgan Stanley	4.821	0,00
(16.100)	Copa Holdings SA Class A	Morgan Stanley	0	0,00
5.321	Copart Inc	Morgan Stanley	432	0,00
45.625	Copart Inc	JPMorgan Chase Bank	468	0,00
13.600	Corcept Therapeutics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
800	Core & Main Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(20.300)	Core Laboratories NV	Morgan Stanley	0	0,00
6.900	CoreCivic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(156.040)	Corning Inc	JPMorgan Chase Bank	2.002	0,00
(27.700)	Corning Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(28.200)	Corporate Office Properties Trust	Morgan Stanley	0	0,00
9.800	Corsair Gaming Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.600	Corteva Inc	Morgan Stanley	0	0,00
900	CorVel Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.200)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.087	0,00
69.600	Costamare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
33.487	CoStar Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.151.136	Costco Wholesale Corp	JPMorgan Chase Bank	171.711	0,01
1.940.993	Costco Wholesale Corp	Morgan Stanley	29.581	0,00
738.242	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs International	11.264	0,00
1.450.113	Coterra Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	5.602	0,00
60.321	Coterra Energy Inc	Goldman Sachs International	147	0,00
(6.956)	Coterra Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
236.400	Coty Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(8.400)	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	0	0,00
226.800	Coupang Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.100	Coursera Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(128.400)	Cousins Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(19.900)	Cowen Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	CRA International Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.764.988	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Morgan Stanley	52.258	0,00
5.600	Crane Holdings Co	Morgan Stanley	0	0,00
(1.880)	Cranswick Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.221	0,00
6.700	Create Restaurants Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	80	0,00
13.000	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(6.800)	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	0	0,00
18.300.000	Credit Agricole SA	Société Générale	258.343	0,01
(705.695)	Credit Agricole SA	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Credit Saison Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	50	0,00
6.000.000	Credit Suisse Group AG	Société Générale	135.968	0,01
(47.000)	Credo Technology Group Holding Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
6.424	Crest Nicholson Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	204	0,00
(9.600)	Crestwood Equity Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
1.151.007	CRISPR Therapeutics AG	JPMorgan Chase Bank	319.467	0,01
244.500	CRISPR Therapeutics AG	Morgan Stanley	70.476	0,00
219.218	CRISPR Therapeutics AG	Goldman Sachs International	84.527	0,00
(1.400)	Crocs Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.550)	Croda International Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.376	0,00
693.934	Croda International Plc	Goldman Sachs International	14.644	0,00
316.742	Cross Country Healthcare Inc	Goldman Sachs International	35.446	0,00
(42.100)	Cross Country Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.511	CrowdStrike Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	542	0,00
66.109	CrowdStrike Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	3.420	0,00
175.288	CrowdStrike Holdings Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	15.307	0,00
15.100	Crown Castle Inc	Morgan Stanley	0	0,00
24.845	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25.500	CryoPort Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.400)	CSG Systems International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	CSW Industrials Inc	Morgan Stanley	0	0,00
951.945	CSX Corp	Morgan Stanley	17.666	0,00
1.985.684	CSX Corp	Goldman Sachs International	62.437	0,00
2.465.062	CSX Corp	JPMorgan Chase Bank	34.943	0,00
900	CTS Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.700	CubeSmart	Morgan Stanley	0	0,00
4.100	Cullen/Frost Bankers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
23.760	Cummins Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.300	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(104.600)	Cushman & Wakefield Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	Customers Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(20.000)	Cutera Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.200)	CVB Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
2.000	CVR Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.400)	CVR Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
156.444	CVS Health Corp	JPMorgan Chase Bank	8.571	0,00
5.241.995	CVS Health Corp	Morgan Stanley	79.172	0,00
3.858.077	CVS Health Corp	Goldman Sachs International	128.254	0,01
845.555.685	CyberAgent Inc	Société Générale	0	0,00
3.000	CyberArk Software Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
18.600	Cytek Biosciences Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(104.222)	Cytokinetics Inc	Goldman Sachs International	11.548	0,00
(737.904)	Cytokinetics Inc	JPMorgan Chase Bank	105.519	0,01
63.239	D and Z Media Acquisition Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.799.982)	D and Z Media Acquisition Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Daihen Corp	Bank of America Merrill Lynch	773	0,00
(476.655)	Daimler AG	Morgan Stanley	27.307	0,00
(2.877.139)	Daimler AG	Goldman Sachs International	2.396	0,00
(12.704)	Daimler Truck Holding AG	JPMorgan Chase Bank	1.500	0,00
(2.800)	Daiwa Securities Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4	0,00
4.700	Daiwabo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.893	0,00
37.000	Dana Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.682.509	Danaher Corp	JPMorgan Chase Bank	8.202	0,00
574.949	Danaher Corp	Goldman Sachs International	1.158	0,00
(1.500)	Danaher Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.800	Danaos Corp	Morgan Stanley	0	0,00
645.804	Danone SA	Morgan Stanley	3.971	0,00
300.644	Danone SA	JPMorgan Chase Bank	7.756	0,00
22.410	Daqo New Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
69.489	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(566.182)	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	1.069	0,00
26.520	Datadog Inc Class A	Goldman Sachs International	710	0,00
169.929	Datadog Inc Class A	Morgan Stanley	9.314	0,00
4.100	Dave & Buster's Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
300	DaVita Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.900	DCM Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.006	0,00
(9.600)	DCP Midstream LP	Morgan Stanley	0	0,00
(2.543)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.150	0,00
(1.527.182)	Deckers Outdoor Corp	Goldman Sachs International	138.720	0,01
(6.188.354)	Deckers Outdoor Corp	JPMorgan Chase Bank	480.029	0,02
(1.501.040)	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	123.667	0,00
1.949.302	Deere & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
17.116	Deere & Co	Morgan Stanley	155.267	0,01
(20.400)	Definitive Healthcare Corp	Morgan Stanley	55	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
38.300	Delek US Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(49.117)	Deliveroo Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.046	0,00
(51.500)	Dell Technologies Inc Class C	Morgan Stanley	0	0,00
14.339	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.100	DeNA Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.533	0,00
56.808	Denali Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	10.400	0,00
606.182	Denali Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	37.703	0,00
(510.002)	Denbury Inc	JPMorgan Chase Bank	7.925	0,00
(207.113)	Denbury Inc	Goldman Sachs International	712	0,00
25.464	Denbury Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	Denso Corp	Bank of America Merrill Lynch	38	0,00
(28.200)	Dentsply Sirona Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	Dentsu Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	367	0,00
(10.151)	Derwent London Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.212	0,00
1.500	Descente Ltd	Bank of America Merrill Lynch	969	0,00
37.100	Designer Brands Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
37.663.208	Deutsche Lufthansa AG	Société Générale	249.204	0,01
583.019	Deutsche Post AG	Goldman Sachs International	8.303	0,00
4.370.049	Deutsche Telekom AG	Goldman Sachs International	0	0,00
1.933	Deutschen Telekom AG ADR	Morgan Stanley	35	0,00
15.370	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.379)	Devon Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
61.500	Dexcom Inc	Morgan Stanley	0	0,00
101.500	DHT Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
482.166	Diageo Plc	Goldman Sachs International	14.118	0,00
1.023.531	Diageo Plc	JPMorgan Chase Bank	29.272	0,00
(55.500)	Diamond Offshore Drilling Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.087	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(42.800)	DiamondRock Hospitality Co	Morgan Stanley	0	0,00
20.742.455	DiaSorin SpA	Société Générale	153.775	0,01
(23.700)	DICE Therapeutics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.547.820)	Dick's Sporting Goods Inc	JPMorgan Chase Bank	117.596	0,01
(4.600)	Dick's Sporting Goods Inc	Morgan Stanley	0	0,00
131.000	Diebold Nixdorf Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.100)	Digi International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
300	Digital Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	126	0,00
(24.700)	Digital Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(75.000)	Digital Turbine Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.200	DigitalBridge Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
53.800	DigitalOcean Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.600)	Dillard's Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
3.000	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.555.290)	Dino Polska SA	JPMorgan Chase Bank	40.963	0,00
(767.244)	Dino Polska SA	Morgan Stanley	24.521	0,00
(2.336.988)	Dino Polska SA	Goldman Sachs International	105.140	0,01
(7.300)	Diodes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	Dip Corp	Bank of America Merrill Lynch	564	0,00
(4.559)	Diploma Plc	Bank of America Merrill Lynch	6.031	0,00
82.496	Direct Line Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.794	0,00
(100)	Disco Corp	Bank of America Merrill Lynch	587	0,00
(199.766.566)	Disco Corp	JPMorgan Chase Bank	202.565	0,01
17.100	Discover Financial Services	Morgan Stanley	0	0,00
(115)	DiscoverE Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	34	0,00
1.521.194	DISH Network Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(96.932)	Diversified Energy Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.402	0,00
(78.100)	Dlocal Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(9.600)	DMG Mori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.618	0,00
(86.400)	DocGo Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.700	DocuSign Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.000)	Dolby Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(153.281)	Dollar General Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.534.821)	Dollar General Corp	JPMorgan Chase Bank	9.158	0,00
(10.300)	Dollar General Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.514.426	Dollar Tree Inc	JPMorgan Chase Bank	49.423	0,00
(860.476)	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	Dollar Tree Inc	Morgan Stanley	0	0,00
61.000	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.762	Domino's Pizza Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.873	0,00
364.944	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	2.618	0,00
9.600	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.500)	Donnelley Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
112.083	DoorDash Inc Class A	Goldman Sachs International	9.461	0,00
3.458.001	DoorDash Inc Class A	Morgan Stanley	118.932	0,00
63.659	DoorDash Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	7.519	0,00
(9.000)	Dorman Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
164.719	dotdigital group Plc	Bank of America Merrill Lynch	11.341	0,00
42.000	DoubleVerify Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.100)	Douglas Emmett Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.590.177	Dover Corp	JPMorgan Chase Bank	41.774	0,00
(9.300)	Dover Corp	Morgan Stanley	0	0,00
18.495	Dow Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.000	Dowa Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	168	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(15.400)	Doximity Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
41.617	Doximity Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.307	0,00
(51.200)	DR Horton Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(612.972)	Dr Ing hc F Porsche AG	Goldman Sachs International	22.809	0,00
(102.646)	Dr Martens Plc	Bank of America Merrill Lynch	34.127	0,00
(7.251)	Draegerwerk AG & Co KGaA	Morgan Stanley	859	0,00
131.300	DraftKings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(705.003)	Drax Group Plc	Morgan Stanley	263.229	0,01
(584.463)	Drax Group Plc	JPMorgan Chase Bank	169.213	0,01
(65.630)	Drax Group Plc	Goldman Sachs International	12.589	0,00
50.200	Driven Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
102.400	Dropbox Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(36.122)	DS Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.858	0,00
(1.300)	DT Midstream Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.900	DTE Energy Co	Morgan Stanley	0	0,00
(31.400)	Duck Creek Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.100	Duckhorn Portfolio Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.822.069	Dufry AG	Société Générale	0	0,00
37.200.000	Dufry One BV	Société Générale	778.820	0,03
(29.100)	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(81.600)	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.700)	Duolingo Inc	Morgan Stanley	0	0,00
72.364	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
126.760	Dutch Bros Inc Class A	Morgan Stanley	20.206	0,00
(12.200)	DXC Technology Co	Morgan Stanley	0	0,00
1.000	Dycom Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
28.400	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(189.316)	Dyne Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	10.571	0,00
(205.262)	Dyne Therapeutics Inc	Morgan Stanley	78.878	0,00
(424.906)	Dyne Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	103.069	0,01
(924.342)	E.ON SE	Morgan Stanley	45.684	0,00
(110.600)	EZopen Parent Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(15.500)	Eagle Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.800)	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.700	Earth Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.354	0,00
35.800	Earthstone Energy Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	East Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	2.043	0,00
(700)	East West Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.900	Easterly Government Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
55.400	Eastern Bankshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.000	EastGroup Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(396.971)	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.771.041)	easyJet Plc	Goldman Sachs International	21.027	0,00
(4.868.988)	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs International	259.895	0,01
(311.963)	Eaton Corp Plc	JPMorgan Chase Bank	8.982	0,00
(6.700)	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.500)	Ebara Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.298	0,00
14.500	eBay Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.700	Ecolab Inc	Morgan Stanley	0	0,00
88.100	Ecovyst Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(28.909)	Edenred	Société Générale	0	0,00
320.696	Edgewell Personal Care Co	Morgan Stanley	13.435	0,00
787.400	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs International	37.313	0,00
(516.552)	Edison International	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.500)	Edison International	Morgan Stanley	0	0,00
67.100	Edwards Lifesciences Corp	Morgan Stanley	0	0,00
719.742	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs International	1.456	0,00
115.438	eFFECTOR Therapeutics	Goldman Sachs International	0	0,00
600	eGuarantee Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.175	0,00
(81.400)	Elanco Animal Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
40.710	Elastic NV	Morgan Stanley	871	0,00
61.166	Elastic NV	JPMorgan Chase Bank	12.736	0,00
5.000	Electric Power Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.788	0,00
3.755.601	Electrolux AB Class B	Morgan Stanley	7.210	0,00
(9.900)	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
272.784	Electronic Arts Inc	JPMorgan Chase Bank	1.947	0,00
(26.100)	Element Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
326.779	Elevance Health Inc	Morgan Stanley	1.442	0,00
2.193.612	Elevance Health Inc	JPMorgan Chase Bank	40.779	0,00
219.123	Elevance Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
95.690	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	427	0,00
(1.206.371)	Eli Lilly & Co	JPMorgan Chase Bank	96.472	0,01
(1.479.112)	Eli Lilly & Co	Morgan Stanley	23.509	0,00
(10.817.562)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	280.505	0,01
(10.700)	Ellington Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.600.000	ELM BV for Swiss Re Ltd	Société Générale	308.603	0,01
8.200	Elme Communities	Morgan Stanley	0	0,00
1.627.923	Elme Communities	Goldman Sachs International	6.605	0,00
1.430.152	Embecta Corp	Goldman Sachs International	268.944	0,01
43.960	Embecta Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(124.488)	Emergent BioSolutions Inc	JPMorgan Chase Bank	7.967	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(80.535)	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	0	0,00
(225.774)	EMIS Group Plc	Goldman Sachs International	2.494	0,00
45.800	Empire State Realty Trust Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
452.927	Enagas SA	JPMorgan Chase Bank	91.099	0,00
3.356.656	Enagas SA	Goldman Sachs International	603.986	0,02
239.020	Enagas SA	Morgan Stanley	4.225	0,00
(1.300)	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(23.100)	Encore Capital Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.000)	Encore Wire Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(154.108)	Endeavor Group Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	12.956	0,00
(180.001)	Endeavor Group Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	21.648	0,00
775.938	Energizer Holdings Inc	Morgan Stanley	68.274	0,00
5.300	Energy Recovery Inc	Morgan Stanley	0	0,00
219.900	Energy Transfer LP	Morgan Stanley	0	0,00
(52.900)	Energy Vault Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Enerpac Tool Group Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.900)	EnerSys	Morgan Stanley	0	0,00
8.500	EngageSmart Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(845.775)	Engie SA	Goldman Sachs International	67.310	0,00
(836.598)	Engie SA	JPMorgan Chase Bank	19.939	0,00
988	Enhabit Inc	Morgan Stanley	27	0,00
62.054	Enhabit Inc	Goldman Sachs International	2.738	0,00
47.332	Enhabit Inc	JPMorgan Chase Bank	954	0,00
3.129.240	Eni SpA	JPMorgan Chase Bank	201.217	0,01
1.788.035	Eni SpA	Goldman Sachs International	3.807	0,00
(41.600)	EnLink Midstream LLC	Morgan Stanley	0	0,00
10.900	Enova International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
67	Enovis Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(13.100)	Enovix Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.467.405	Enphase Energy Inc	Morgan Stanley	171.233	0,01
1.530.805	Enphase Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	98.030	0,00
48.026	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs International	6.056	0,00
(9.600)	EnPro Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(603.437)	Ensign Group Inc	Morgan Stanley	14.884	0,00
(3.200)	Enstar Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(1.477.429)	Entain Plc	Goldman Sachs International	83.611	0,00
(508.142)	Entain Plc	Morgan Stanley	9.568	0,00
(504.550)	Entain Plc	JPMorgan Chase Bank	51.696	0,00
53.833	Entegris Inc	Morgan Stanley	638	0,00
108.744	Entegris Inc	Goldman Sachs International	15.864	0,00
27.300	Entergy Corp	Morgan Stanley	0	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(4.900)	Enterprise Financial Services Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(25.800)	Enterprise Products Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
424.900	Envestnet Inc	Nomura	0	0,00
(12.000)	Envestnet Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.698.846	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs International	75.376	0,00
6.400	Envista Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.895.414	Enviva Inc	Goldman Sachs International	44.659	0,00
505.087	Enviva Inc	Morgan Stanley	29.665	0,00
907.947	Enviva Inc	JPMorgan Chase Bank	166.647	0,01
(209.306)	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	29.953	0,00
159.123	EPAM Systems Inc	JPMorgan Chase Bank	5.229	0,00
3.500	EPAM Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
223.888	Epiroc AB Class A	Morgan Stanley	717	0,00
(7.900)	ePlus Inc	Morgan Stanley	0	0,00
21.200	EPR Properties	Morgan Stanley	0	0,00
57.100	EQT Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	Equifax Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.300)	Equinix Inc	Morgan Stanley	0	0,00
28.500	Equitable Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
412.700	Equitrans Midstream Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(15.500)	Equity Commonwealth	Morgan Stanley	0	0,00
(13.500)	Equity LifeStyle Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.473.987	Equity Residential	Goldman Sachs International	145.635	0,01
18.700	Equity Residential	Morgan Stanley	0	0,00
(4.900)	Erie Indemnity Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(925.255)	Erste Group Bank AG	JPMorgan Chase Bank	115.395	0,01
(461.614)	Erste Group Bank AG	Morgan Stanley	45.675	0,00
(27.733)	Esab Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.200	ESCO Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.787)	ESM Acquisition Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.700)	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(17.700)	Essential Properties Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.200	Essential Utilities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.900	Essex Property Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
434.700	EssilorLuxottica SA	Morgan Stanley	3.965	0,00
(22.600)	Establishment Labs Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.745.715)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Morgan Stanley	275.552	0,02
(2.206.384)	Estee Lauder Cos Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	159.942	0,01
(6.670.572)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Goldman Sachs International	567.033	0,02
1.230.937	Etsy Inc	Morgan Stanley	55.397	0,00
1.454.750	Eurofins Scientific SE	JPMorgan Chase Bank	100.862	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(8.100)	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.800	Everbridge Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.300)	Evercore Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
34.300	Evergy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
59.300	Everi Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.800)	Eversource Energy	Morgan Stanley	0	0,00
11.500	EVERTEC Inc	Morgan Stanley	0	0,00
207.913	EVgo Inc	JPMorgan Chase Bank	125.459	0,01
167.313	EVgo Inc	Goldman Sachs International	96.053	0,01
37.464	EVgo Inc	Morgan Stanley	21.568	0,00
(53.706)	Evo Payments Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.137	0,00
(10.400)	Evo Payments Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(45.700)	Evolent Health Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(498.506)	Evolent Health Inc Class A	Goldman Sachs International	10.219	0,00
(419.024)	Evonik Industries AG	Morgan Stanley	52.091	0,00
7.000	Evoqua Water Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(59.472)	Exelixis Inc	JPMorgan Chase Bank	132	0,00
(787.775)	Exelon Corp	JPMorgan Chase Bank	21.014	0,00
(268.906)	Exelon Corp	Goldman Sachs International	690	0,00
(82.600)	Exelon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
5.700	ExlService Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
751	EXOR NV	Goldman Sachs International	0	0,00
96.400	eXp World Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.500.000	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	20.821	0,00
18.000	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(25.500)	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(35.800)	Expensify Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.480)	Experian Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.623	0,00
148.251	Experian Plc	Goldman Sachs International	6.688	0,00
7.200	Exponent Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(37.711)	Expro Group Holdings NV	Morgan Stanley	0	0,00
8.600	Extra Space Storage Inc	Morgan Stanley	0	0,00
63.000	Extreme Networks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.804.848)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	161.568	0,01
(3.678.826)	Exxon Mobil Corp	JPMorgan Chase Bank	158.915	0,00
(10.971.991)	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs International	1.066.748	0,04
(700)	F&G Annuities & Life Inc	Morgan Stanley	0	0,00
525.146	F5 Inc	Morgan Stanley	1.992	0,00
3.400	F5 Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	Fabrinet	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
131.669	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	0	0,00
22.175.811	Fancl Corp	Société Générale	0	0,00
6.000	Fancl Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.601	0,00
(514.831)	Farfetch Ltd Class A	Morgan Stanley	2.090	0,00
30.653	Fast Radius Inc	Goldman Sachs International	18	0,00
100	Fast Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.658	0,00
(91.420)	Fastenal Co	Morgan Stanley	0	0,00
386.757	Fate Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	240.917	0,01
200.194	Fate Therapeutics Inc	Morgan Stanley	85.187	0,00
16.105	Fate Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	57.720	0,00
9.170	Fathom Digital Manufacturing Corpora	Goldman Sachs International	0	0,00
(961)	Faurecia SE	Morgan Stanley	26	0,00
9.900	FB Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(9.200)	Federal Realty Investment Trust	Morgan Stanley	0	0,00
5.500	Federal Signal Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(96.841)	Federated Hermes Inc	Morgan Stanley	4.204	0,00
(1.056.878)	Federated Hermes Inc	JPMorgan Chase Bank	39.462	0,00
117.785	FedEx Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
8.700	FedEx Corp	Morgan Stanley	14.352	0,00
58.808	Ferguson Plc	Morgan Stanley	0	0,00
127.657	Ferrexpo Plc	Bank of America Merrill Lynch	55.064	0,00
(35.400)	Ferroglobe Plc	Morgan Stanley	0	0,00
17.272	Fevertree Drinks Plc	Bank of America Merrill Lynch	27.086	0,00
(715.109)	FibroGen Inc	Goldman Sachs International	168.773	0,01
(962.086)	FibroGen Inc	Morgan Stanley	292.835	0,01
(890.484)	FibroGen Inc	JPMorgan Chase Bank	224.601	0,01
(16.500)	Fidelity National Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(22.700)	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.100)	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(700)	Figs Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(58.700)	First Advantage Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(15.200)	First American Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
34.000	First BanCorp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.300)	First Citizens BancShares Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
36.600	First Commonwealth Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
17.600	First Financial Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
30.900	First Financial Bankshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.000)	First Foundation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(24.600)	First Hawaiian Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(62.000)	First Horizon Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(545.099)	First Horizon Corp	JPMorgan Chase Bank	54.034	0,00
26.900	First Industrial Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
35.962	First Interstate BancSystem Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
4.100	First Merchants Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(21.700)	First Republic Bank	Morgan Stanley	0	0,00
1.831.754	First Solar Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	First Solar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.800)	FirstCash Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(647.057)	FirstEnergy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(42.000)	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(100.853)	Firstgroup Plc	Bank of America Merrill Lynch	11.774	0,00
7.663.859	FirstRand Ltd	Morgan Stanley	22.016	0,00
14.514.903	FirstRand Ltd	JPMorgan Chase Bank	38.909	0,00
176.534	Fiserv Inc	Morgan Stanley	1.222	0,00
(267.705)	Fisker Inc	Morgan Stanley	21.091	0,00
(559.987)	Fisker Inc	Goldman Sachs International	28.653	0,00
(128.800)	Fisker Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.100)	Five Below Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(70.186)	Five9 Inc	JPMorgan Chase Bank	17	0,00
(16.000)	Five9 Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.500	Fiverr International Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(1.200)	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(268.624)	Flex Ltd	JPMorgan Chase Bank	57.917	0,00
(188.620)	Flex Ltd	Morgan Stanley	8.059	0,00
1.388.549	Floor & Decor Holdings Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	74.078	0,00
237.362	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	18.295	0,00
4.234.756	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	124.662	0,01
4.300	Flowserve Corp	Morgan Stanley	0	0,00
326.772	FLSmith & Co A/S	Morgan Stanley	5.664	0,00
(86.900)	Fluence Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
107.308	Fluor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(290)	Flutter Entertainment Plc	Bank of America Merrill Lynch	844	0,00
(14.000)	FMC Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.400)	FNB Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(21.100)	Focus Financial Partners Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(4.600)	Food & Life Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.851	0,00
28.900	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.333.968)	Foran Mining Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.487.473	Ford Motor Co	Nomura	0	0,00
13.200.000	Ford Motor Co	Goldman Sachs International	20.683	0,00
(3.000)	FormFactor Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
365.227	Fortinet Inc	Morgan Stanley	10.709	0,00
177.655	Fortinet Inc	JPMorgan Chase Bank	9.465	0,00
75.140	Fortive Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.400)	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC Class A	Morgan Stanley	3.224	0,00
(500.883)	Fortum Oyj	Goldman Sachs International	28.014	0,00
255.370	Fortum Oyj	Morgan Stanley	12.060	0,00
50.401	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.100	Forward Air Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.068.758	Foschini Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	15.970	0,00
3.300	Four Corners Property Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.400	Fox Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
23.600	Fox Corp Class B	Morgan Stanley	0	0,00
118.438	Fox Factory Holding Corp	Morgan Stanley	15.034	0,00
200	FP Corp	Bank of America Merrill Lynch	391	0,00
(29.400)	Franchise Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
30.000	Franklin BSP Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.300)	Franklin Electric Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(71.700)	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.326.684)	Freenet AG	Goldman Sachs International	0	0,00
111.210	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.700	Fresh Del Monte Produce Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.900)	Freshpet Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(80.100)	Freshworks Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(36.200)	FREYR Battery SA	Morgan Stanley	0	0,00
60.300	Frontdoor Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.400)	Frontier Communications Parent Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.000	Frontier Group Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(874.647)	Frontier Investment Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(45.910)	Frontline Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
31.100	FS KKR Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.400)	FTAI Infrastructure Inc	Morgan Stanley	0	0,00
158.116	FTI Consulting Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.600)	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	Fuji Co Ltd/Ehime	Bank of America Merrill Lynch	2.004	0,00
2.600	Fuji Corp	Bank of America Merrill Lynch	936	0,00
8.800	Fuji Oil Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.435	0,00
700	Fuji Soft Inc	Bank of America Merrill Lynch	625	0,00
400	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	16	0,00
2.000	Fujikura Ltd	Bank of America Merrill Lynch	242	0,00
(2.400)	Fujimi Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.474	0,00
2.800	Fujitsu General Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.667	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.700	Fukuyama Transporting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.133	0,00
5.600	Fulgent Genetics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(483.963)	Full Truck Alliance Co Ltd	Goldman Sachs International	187.414	0,01
(1.444.454)	Full Truck Alliance Co Ltd	Morgan Stanley	233.439	0,01
(863.485)	Full Truck Alliance Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	338.135	0,01
(2.200)	FULLCAST Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	603	0,00
76.100	Fulton Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(22.700)	Funko Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(5.200)	Furukawa Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.637	0,00
(13.615)	Future Plc	Bank of America Merrill Lynch	23.979	0,00
(1.745.324)	Gaming & Hospitality Acquisition Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Gaming and Leisure Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.000	Gap Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.000)	Garmin Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
8.800	Gartner Inc	Morgan Stanley	0	0,00
47.300	Gates Industrial Corp Plc	Morgan Stanley	0	0,00
1.700	GATX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
16.645	Gaztransport Et Technigaz SA	Goldman Sachs International	674	0,00
1.578.401	Geberit AG	JPMorgan Chase Bank	4.832	0,00
342.216	Geberit AG	Goldman Sachs International	27.200	0,00
(231.300)	Gen Digital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.600)	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
32.868	General Electric Co	Goldman Sachs International	0	0,00
29.850	General Electric Co	Morgan Stanley	0	0,00
629.986	General Mills Inc	Goldman Sachs International	1.651	0,00
538.037	General Mills Inc	JPMorgan Chase Bank	9.123	0,00
(37.100)	General Mills Inc	Morgan Stanley	0	0,00
68.603	General Motors Co	Morgan Stanley	0	0,00
40.800	Genesis Energy LP	Morgan Stanley	0	0,00
154.967	Genesis Energy LP	Goldman Sachs International	19.939	0,00
75.759	Genesis Energy LP	JPMorgan Chase Bank	13.435	0,00
8.190.472	Genmab A/S	Morgan Stanley	90.849	0,00
1.180.610	Genmab A/S	JPMorgan Chase Bank	13.950	0,00
(20.300)	Genpact Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(16.900)	Gentex Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.000)	Gentherm Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.900	Genuine Parts Co	Morgan Stanley	0	0,00
(7.078)	Genuit Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	4	0,00
(60.900)	Genworth Financial Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(69.800)	GEO Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.795)	Gerresheimer AG	Morgan Stanley	4.195	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(32.300)	Getty Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.500)	Gibraltar Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.700	giftee Inc	Bank of America Merrill Lynch	67.581	0,00
(17.000)	G-III Apparel Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
1.117.651	Gildan Activewear Inc	Morgan Stanley	86.704	0,00
(37.300)	Gitlab Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
573.934	Givaudan SA	Goldman Sachs International	25.581	0,00
254.034	Givaudan SA	JPMorgan Chase Bank	17.532	0,00
405.960	Givaudan SA	Morgan Stanley	47.100	0,00
23.800	Glacier Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.900	Glaukos Corp	Morgan Stanley	0	0,00
7.600.000	Glencore Funding LLC	Société Générale	31.121	0,00
(34.945)	Glencore Plc	Goldman Sachs International	31.239	0,00
(390.768)	Glencore Plc	Morgan Stanley	41.464	0,00
111.761	Glencore Plc	JPMorgan Chase Bank	6.874	0,00
2.410.703	Glencore Plc	Société Générale	0	0,00
33.150	Glenfarne Merger Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(916.991)	Glenfarne Merger Corp Clas A	Goldman Sachs International	0	0,00
37.600	Global Net Lease Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Global Partners LP/MA	Morgan Stanley	0	0,00
(2.000)	Global Payments Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(197.979)	Global-e Online Ltd	Morgan Stanley	16.870	0,00
3.154.268	Globalfoundries Inc	Goldman Sachs International	223.739	0,01
1.097.635	Globalfoundries Inc	Morgan Stanley	160.704	0,01
4.400	Globant SA	Morgan Stanley	0	0,00
(1.200)	Globe Life Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.400)	Globus Medical Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	Glory Ltd	Bank of America Merrill Lynch	812	0,00
1.100	GMO internet group Inc	Bank of America Merrill Lynch	487	0,00
158.325.500	GMO Payment Gateway Inc	Société Générale	0	0,00
(400)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.099	0,00
(3.200)	GMS Inc	Morgan Stanley	0	0,00
23.500	GoDaddy Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(22.000)	Gogo Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.500	Golar LNG Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
14.900	Golden Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(101.600)	Golden Ocean Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
612.518	Goldman Sachs Group Inc	Nomura	0	0,00
(31.018)	Goodyear Tire & Rubber Co	Morgan Stanley	0	0,00
12.000	Goosehead Insurance Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
51.000	Graco Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(8.600)	GrafTech International Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(2.400)	Graham Holdings Co Class B	Morgan Stanley	0	0,00
(2.000)	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.500	Granite Construction Inc	Morgan Stanley	0	0,00
43.900	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	0	0,00
73.900	Gray Television Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(29.641)	Great Portland Estates Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.961	0,00
(22.300)	Green Brick Partners Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25.300	Green Dot Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
9.100	Green Plains Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.100	Greenbrier Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.500	Greif Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
600	Grid Dynamics Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.500)	Griffon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(21.735)	Grifols SA	Morgan Stanley	810	0,00
(214.721)	Grifols SA	JPMorgan Chase Bank	5.136	0,00
(154.276)	Grifols SA	Goldman Sachs International	229	0,00
588.468	Grocery Outlet Holding Corp	Goldman Sachs International	48.573	0,00
2.234.217	Grocery Outlet Holding Corp	Morgan Stanley	129.734	0,01
2.509.167	Grocery Outlet Holding Corp	JPMorgan Chase Bank	118.627	0,01
1.500	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.700	GS Yuasa Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.057	0,00
245.319	GSK Plc	JPMorgan Chase Bank	0	0,00
524.550	Guardant Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
24.361	Guardant Health Inc	Morgan Stanley	6.618	0,00
(18.200)	Guess? Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(22.500)	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.100	Gulfport Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(28.200)	GXO Logistics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.468.719	H & M Hennes & Mauritz AB Class B	Morgan Stanley	1.639	0,00
(751.204)	H World Group Ltd	Morgan Stanley	51.391	0,00
12.000	H&E Equipment Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(769.750)	H&R Block Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(57.500)	H&R Block Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.100	H.U. Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.423	0,00
14.600	H2O Retailing Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.972	0,00
25.900	Hachijuni Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.511	0,00
19.400	Haemonetics Corp	Morgan Stanley	0	0,00
502.477	Hain Celestial Group Inc	Goldman Sachs International	66.385	0,00
47.700	Hain Celestial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(64.000)	Halliburton Co	Morgan Stanley	0	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(2.000)	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America Merrill Lynch	1.976	0,00
18.300	Hamilton Lane Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
237.366	Hammerson Plc	Bank of America Merrill Lynch	164	0,00
(900)	Hancock Whitney Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(162.700)	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.900	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	Hanover Insurance Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
900	Hanwa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.364	0,00
(20.053)	Harbour Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.951	0,00
58.856	Hargreaves Lansdown Plc	Bank of America Merrill Lynch	10.831	0,00
145.716	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs International	16.121	0,00
981.383	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	88.021	0,00
3.400	Harmonic Drive Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.115	0,00
(28.500)	Harmonic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
156.353	Harmony Biosciences Holdings Inc	Morgan Stanley	5.853	0,00
34.200	Hartford Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.800	Hasbro Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.500	Haseko Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.561	0,00
(19.100)	HashiCorp Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
4.900	Hawaiian Electric Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.056.952	Hays Plc	Goldman Sachs International	1.854	0,00
(141.300)	Hayward Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.700	Hazama Ando Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.465	0,00
(5.000)	HB Fuller Co	Morgan Stanley	0	0,00
(889.939)	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	12.773	0,00
(78.731)	HCA Healthcare Inc	JPMorgan Chase Bank	5.383	0,00
310.648	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(25.500)	Healthcare Realty Trust Inc	Morgan Stanley	167.399	0,01
30.300	Healthcare Services Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.900	HealthEquity Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(325.082)	Healthpeak Properties Inc	JPMorgan Chase Bank	8.721	0,00
(2.770.593)	Healthpeak Properties Inc	Goldman Sachs International	14.715	0,00
33.900	Healthpeak Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
31.000	Heartland Express Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.700	Heartland Financial USA Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(600)	HEICO Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.300	HEICO Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(53.808)	HeidelbergCement AG	Morgan Stanley	19.769	0,00
(2.200)	Heiwa Real Estate Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.784	0,00
4.700	Heiwado Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16.550	0,00
1.300	Helen of Troy Ltd	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(10.700)	Helios Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
130.100	Helix Energy Solutions Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.100	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	0	0,00
82.931	Henkel AG & Co KGaA	Goldman Sachs International	27	0,00
28.829	Hennessy Capital LLC	Morgan Stanley	161	0,00
6.600	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.785.749	Henry Schein Inc	Goldman Sachs International	1.796	0,00
8.565.528	Herbalife Nutrition Ltd	Nomura	0	0,00
11.750.000	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs International	184.742	0,01
1.800	Herc Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.100	Heritage Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.760.103)	Hershey Co	Morgan Stanley	491.238	0,02
(711.165)	Hershey Co	Goldman Sachs International	24.815	0,00
(1.300)	Heska Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.303.956	Hess Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	Hess Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.800)	Hess Midstream LP Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(53.000)	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	0	0,00
416.271	Hexagon AB	Morgan Stanley	16.394	0,00
(718.719)	Hexcel Corp	Morgan Stanley	28.475	0,00
22.000	HF Sinclair Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(900)	Hibbett Sports Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.500	Hiday Hidaka Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.022	0,00
(37.800)	Highwoods Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	Hikari Tsushin Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.007	0,00
(4.147)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.293	0,00
4.134	Hill & Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.763	0,00
10.800	Hillenbrand Inc	Morgan Stanley	0	0,00
38.900	Hillman Solutions Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(11.400)	Hilltop Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.000	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.057.055	Hilton Worldwide Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	56.062	0,00
6.850.545	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	144.493	0,01
(122.600)	Hims & Hers Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.200)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.715	0,00
4.200	Hitachi Zosen Corp	Bank of America Merrill Lynch	156	0,00
13.200	HNI Corp	Morgan Stanley	0	0,00
5.400	Hokuhoku Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.652	0,00
(32.400)	Hollysys Automation Technologies Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
25.700	Hologic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
34.300	Home BancShares Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
3.542.771	Home Depot Inc	JPMorgan Chase Bank	29.563	0,00
7.920.635	Home Depot Inc	Morgan Stanley	20.345	0,00
(298.038)	HomeServe Plc	Goldman Sachs International	5.721	0,00
(800)	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	985	0,00
(18.300)	Honeywell International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.100)	Hope Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.400	Horace Mann Educators Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.300)	Horiba Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.681	0,00
(556.891)	Horizon Therapeutics Plc	Morgan Stanley	3.048	0,00
103.654	Hormel Foods Corp	Goldman Sachs International	11.881	0,00
561.603	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	10.103	0,00
15.730.000	Hosiden Corp	Société Générale	0	0,00
1.900	Hosiden Corp	Bank of America Merrill Lynch	161	0,00
240.913	Host Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	715	0,00
(119.800)	Host Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
79.700	Hostess Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.100	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.600	House Foods Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.315	0,00
(3.805.958)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs International	529.187	0,02
(1.243.110)	Howmet Aerospace Inc	JPMorgan Chase Bank	49.463	0,00
(988.160)	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	46.475	0,00
(300)	Hoya Corp	Morgan Stanley	335	0,00
414.832	HP Inc	JPMorgan Chase Bank	1.947	0,00
2.897.867	HP Inc	Morgan Stanley	160.871	0,01
331.575	HSBC Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	184.650	0,01
(1.400)	Hub Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(9.550)	Hubbell Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(201.614)	HubSpot Inc	JPMorgan Chase Bank	8.432	0,00
(300)	HubSpot Inc	Morgan Stanley	0	0,00
66.400	Hudson Pacific Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(20.900)	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.881	0,00
1.566.087	Humana Inc	JPMorgan Chase Bank	25.360	0,00
5.267.750	Humana Inc	Goldman Sachs International	102.687	0,01
3.196	Humana Inc	Morgan Stanley	132.292	0,01
(73.000)	Huntington Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.300	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(63.451)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.500	Huron Consulting Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.179	HUTCHMED China Ltd	Bank of America Merrill Lynch	588	0,00
(2.500.560)	Hyatt Hotels Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	4.577	0,00
9.600	Hyatt Hotels Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(8.100)	IAA Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.900	IAC Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.324	Iberdrola SA	JPMorgan Chase Bank	74	0,00
(6.600)	Icahn Enterprises LP	Morgan Stanley	0	0,00
3.300	ICF International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(305.219)	ICON Plc	Goldman Sachs International	3.015	0,00
(5.100)	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(300)	IDACORP Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.000	IDEX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.900	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.900	IDOM Inc	Bank of America Merrill Lynch	628	0,00
376.130	Idorsia Ltd	Morgan Stanley	16.844	0,00
7.545	Idorsia Ltd	Goldman Sachs International	190	0,00
5.526.063	Idorsia Ltd	Société Générale	370.896	0,01
2.000	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	160	0,00
(19.384)	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	0	0,00
161.803	illumina Inc	Morgan Stanley	6.476	0,00
1.424.079	illumina Inc	JPMorgan Chase Bank	47.871	0,00
500	illumina Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(26.339)	IMAX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
375.955	IMI Plc	Goldman Sachs International	13.093	0,00
138.695	ImmunoGen Inc	JPMorgan Chase Bank	6.142	0,00
1.700	Impinj Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	Inari Medical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(159.102)	Inchcape Plc	Goldman Sachs International	6.349	0,00
345.895	Incyte Corp	JPMorgan Chase Bank	9.578	0,00
(444.561)	Independence Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(83.000)	Independence Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.100)	Independent Bank Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.300)	Independent Bank Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.500	indie Semiconductor Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
8.532	Indivior Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.998	0,00
(59.233)	Industria de Diseno Textil SA	Morgan Stanley	2.341	0,00
(1.009.003)	Infineon Technologies AG	JPMorgan Chase Bank	89.074	0,00
(513.567)	Infineon Technologies AG	Goldman Sachs International	64.344	0,00
36.000	Infinera Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(49.046)	Informa Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.458	0,00
(8.900)	Informatica Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(214.601)	ING Groep NV	Morgan Stanley	27.178	0,00
(251.229)	ING Groep NV	JPMorgan Chase Bank	69.352	0,00
66.722	Ingersoll Rand Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
16.100	Ingevity Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.200)	Ingles Markets Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(4.100)	Ingredion Inc	Morgan Stanley	0	0,00
24.700	Inmode Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(9.100)	Innospec Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.300	Innovative Industrial Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
406	Innovid Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(51.300)	Innoviva Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	Inpex Corp	Bank of America Merrill Lynch	25	0,00
(541.514)	InPost SA	JPMorgan Chase Bank	53.052	0,00
(203.677)	InPost SA	Morgan Stanley	16.687	0,00
(7.000)	Insight Enterprises Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(385.515)	Insmid Inc	Goldman Sachs International	16.311	0,00
9.400	Insperty Inc	Morgan Stanley	0	0,00
560.319	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	5.004	0,00
14.400	Installed Building Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(22.964)	Instructure Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.448.490	Insulet Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
901.228	Insulet Corp	JPMorgan Chase Bank	3.161	0,00
24.139	Insulet Corp	Morgan Stanley	1.600	0,00
(7.000)	Integer Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
25.700	Integra LifeSciences Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
343.660	Intel Corp	Morgan Stanley	4.015	0,00
900	Inter Parfums Inc	Morgan Stanley	0	0,00
34.300	Interactive Brokers Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.059.147)	Interactive Brokers Group Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	11.246	0,00
(4.600)	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.341.485)	Intercontinental Exchange Inc	JPMorgan Chase Bank	53.041	0,00
(632)	InterContinental Hotels Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.136	0,00
(27.800)	InterDigital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(28.374)	Intermediate Capital Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	18.929	0,00
(5.700)	International Bancshares Corp	Morgan Stanley	0	0,00
396.157	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	8.022	0,00
(145.637)	International Business Machines Corp	JPMorgan Chase Bank	68.115	0,00
15.918.064	International Consolidated Airlines Group SA	Société Générale	59.294	0,00
(5.041.354)	International Consolidated Airlines Group SA	Goldman Sachs International	40.152	0,00
(530.474)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	4.312	0,00
(22.900)	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(27.900)	International Money Express Inc	Morgan Stanley	0	0,00
38.200	International Paper Co	Morgan Stanley	0	0,00
(17.400)	International Seaways Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
101.453	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(33.300)	Interpublic Group of Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.359)	Intertek Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	8.139	0,00
165.988	Intra-Cellular Therapies Inc	Goldman Sachs International	259	0,00
9.200	Intra-Cellular Therapies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(240.871)	Intuit Inc	Goldman Sachs International	990	0,00
(25.775)	Intuit Inc	Morgan Stanley	55.292	0,00
(420.162)	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs International	1.740	0,00
19.300	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.000	InvenTrust Properties Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(268.800)	Invesco Ltd	Goldman Sachs International	2.360	0,00
4.500	Invesco Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
25.363	Investec Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.623	0,00
3.596.424	Invitation Homes Inc	Goldman Sachs International	217.935	0,01
99.900	Invitation Homes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
160.780	Ionis Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	3.882	0,00
827.079	Ionis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	52.409	0,00
(178.400)	IonQ Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(136.808)	lovance Biotherapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	3.062	0,00
(134.647)	lovance Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs International	2.550	0,00
(7.400)	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	0	0,00
812.231	IQVIA Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	34.390	0,00
8.700	IQVIA Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(279.832)	iRhythm Technologies Inc	Morgan Stanley	3.070	0,00
(146.450)	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs International	1.451	0,00
(10.100)	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	0	0,00
600	Irigoien Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	540	0,00
(5.400)	iRobot Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(20.300)	Iron Mountain Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(73.776)	ISS A/S	Morgan Stanley	2.770	0,00
(111.200)	iStar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.900)	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.237	0,00
(3.833)	ISX Financial EU Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	ITOCHU Corp	Bank of America Merrill Lynch	17	0,00
2.400	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	200	0,00
(3.800)	Itron Inc	Morgan Stanley	0	0,00
224.040	ITT Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.000)	ITT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.158	ITV Plc	Bank of America Merrill Lynch	107	0,00
(45.840)	Iveco Group NV	Morgan Stanley	11.891	0,00
45.840	Iveco Group NV	Morgan Stanley	16.865	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
5.700	Iyogin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.838	0,00
2.200	Izumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.534	0,00
2.100	J & J Snack Foods Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.922	J D Wetherspoon Plc	Bank of America Merrill Lynch	433	0,00
600	J Front Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	253	0,00
(987.002)	J M Smucker Co	Morgan Stanley	18.380	0,00
(277.038)	J M Smucker Co	Goldman Sachs International	74.097	0,00
(1.686.008)	J M Smucker Co	JPMorgan Chase Bank	73.135	0,00
(388.386)	J Sainsbury Plc	Goldman Sachs International	6.421	0,00
37.700	J Trust Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.380	0,00
124.177	Jabil Inc	JPMorgan Chase Bank	461	0,00
(11.800)	Jabil Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	JAC Recruitment Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	66	0,00
(800)	Jack Henry & Associates Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.100	Jack in the Box Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	Jackson Financial Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	Jacobs Engineering Group Inc	Morgan Stanley	553	0,00
(10.500)	Jacobs Solutions Inc	Morgan Stanley	9.705	0,00
1.400	JAFCO Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	490	0,00
(3.400)	Jamf Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.700	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.700)	Japan Material Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.037	0,00
600	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	32	0,00
16.800	Japan Post Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.235	0,00
16.600	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21.207	0,00
11.688	Jaws Mustang	Goldman Sachs International	0	0,00
12.461	Jaws Mustang	Morgan Stanley	809	0,00
(455.250)	Jaws Mustang Acquisition Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.900)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	0	0,00
7.762	JB Hi-Fi Ltd	Goldman Sachs International	154	0,00
(3.500)	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.500	JBG SMITH Properties	Morgan Stanley	0	0,00
(1.439.582)	JD.com Inc	Goldman Sachs International	97.111	0,01
(347.331)	JD.com Inc	Morgan Stanley	17.189	0,00
476	JD.com Inc Class A	Goldman Sachs International	13.429	0,00
6.500	Jefferies Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
46.700	JELD-WEN Holding Inc	Morgan Stanley	0	0,00
306.942	Jeronimo Martins SGPS SA	JPMorgan Chase Bank	4.530	0,00
302.226	Jeronimo Martins SGPS SA	Morgan Stanley	7.924	0,00
148.108	Jeronimo Martins SGPS SA	Goldman Sachs International	2.672	0,00
328.700	JetBlue Airways Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
22.600	JFrog Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(11.600)	JM Smucker Co	Morgan Stanley	0	0,00
4.700	John Bean Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.300)	John Wiley & Sons Inc Class A	Morgan Stanley	211.010	0,01
11.307	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	1.450	0,00
2.444.523	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	8.257	0,00
(1.135.181)	Johnson Controls International plc	Morgan Stanley	94.854	0,00
(4.590.839)	Johnson Controls International plc	Goldman Sachs International	490.993	0,02
3.030	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.388	0,00
(62.312)	Johnson Matthey Plc	Goldman Sachs International	9.745	0,00
37.307	Johnson Matthey Plc	Morgan Stanley	664	0,00
(4.300)	Jones Lang LaSalle Inc	Morgan Stanley	0	0,00
300	Joyful Honda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	730	0,00
(1.511.915)	JPMorgan Chase & Co	Morgan Stanley	13.278	0,00
(400)	JSR Corp	Bank of America Merrill Lynch	82	0,00
(1.974)	JTC Plc	Bank of America Merrill Lynch	392	0,00
(800)	JTOWER Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.320	0,00
(266.611)	Juniper Networks Inc	Morgan Stanley	89	0,00
(294.343)	Juniper Networks Inc	JPMorgan Chase Bank	51.542	0,00
63.855	Jupiter Fund Management Plc	Bank of America Merrill Lynch	7.212	0,00
677.568	Just Eat Takeaway.com NV	Société Générale	6.435	0,00
300	Kadant Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.800	Kaga Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.533	0,00
11.700	Kaiser Aluminum Corp	Morgan Stanley	0	0,00
300	Kakaku.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	69	0,00
2.700	Kamigumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.106	0,00
3.900	Kaneka Corp	Bank of America Merrill Lynch	116	0,00
3.200	KAO Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.598	0,00
5.400	KAR Auction Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
379.861	Karuna Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	14.862	0,00
247.328	Karuna Therapeutics Inc	Morgan Stanley	32.864	0,00
600	Katitas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	207	0,00
(11.900)	KB Home	Morgan Stanley	0	0,00
(46.600)	KBR Inc	Morgan Stanley	0	0,00
338.335	KE Holdings Inc	Morgan Stanley	13.713	0,00
303.598	KE Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	10.223	0,00
(1.600)	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.669	0,00
5.500	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.598	0,00
22.000	Keikyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	10.846	0,00
(500)	Keio Corp	Bank of America Merrill Lynch	248	0,00
(5.500)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.883.874	Kellogg Co	Morgan Stanley	15.739	0,00
1.622.640	Kellogg Co	Goldman Sachs International	4.029	0,00
19.000	Kemper Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(190.462)	Kennametal Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.758.265	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs International	107.224	0,01
(66.600)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.834.635)	Kering SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.465.761)	Keurig Dr Pepper Inc	Morgan Stanley	23.471	0,00
(2.104.617)	KeyCorp	Goldman Sachs International	0	0,00
358.000	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	5.445	0,00
264.459	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.000)	Kforce Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.277.724)	KGHM Polska Miedz SA	Morgan Stanley	32.983	0,00
(1.446.061)	KGHM Polska Miedz SA	JPMorgan Chase Bank	20.771	0,00
48.200	Kilroy Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(40.300)	Kimbell Royalty Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
968.853	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
22.058	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	31.187	0,00
47.200	Kimco Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
536.076	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs International	1.557	0,00
35.900	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.812.636)	Kindred Group Plc	Morgan Stanley	37.405	0,00
500	Kinetik Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.281.068	Kingfisher Plc	Goldman Sachs International	32.118	0,00
136.042	Kingfisher Plc	JPMorgan Chase Bank	717	0,00
2.600	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(154.180)	KION Group AG	Morgan Stanley	26.803	0,00
841.151	Kirby Corp	Morgan Stanley	42.313	0,00
277.002	Kirby Corp	Goldman Sachs International	9.032	0,00
55.424	Kite Realty Group Trust	Morgan Stanley	0	0,00
3.429.101	Kite Realty Group Trust	Goldman Sachs International	122.074	0,01
14.700	KKR & Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
45.400	KKR Real Estate Finance Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(359.720)	KLA Corp	JPMorgan Chase Bank	11.798	0,00
(100.814)	KLA Corp	Goldman Sachs International	2.594	0,00
383.527	KLA Corp	Morgan Stanley	13.254	0,00
24.192	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(67.805)	Knorr-Bremse AG	Morgan Stanley	15.776	0,00
(18.600)	KnowBe4 Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(42.800)	Knowles Corp	Morgan Stanley	0	0,00
300	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.600	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
448.570.728	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Société Générale	0	0,00
62.000	Kohl's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.100)	Komatsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.760	0,00
73.405.017	Konami Group Corp	Morgan Stanley	13.468	0,00
147.228.012	Konami Group Corp	JPMorgan Chase Bank	12.008	0,00
2.500	Konami Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	566	0,00
(12.000)	Konica Minolta Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.309	0,00
23.865	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	10.521	0,00
(317.257)	Koninklijke KPN NV	Goldman Sachs International	27.969	0,00
(398.183)	Koninklijke KPN NV	Morgan Stanley	30.144	0,00
(1.110.971)	Koninklijke KPN NV	JPMorgan Chase Bank	7.027	0,00
(21.600)	Kontoor Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	Korn Ferry	Morgan Stanley	0	0,00
21.000	Kornit Digital Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
700	Kose Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.696	0,00
21.946	Kosmos Energy Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
400	Kotobuki Spirits Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.054	0,00
149.230	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs International	0	0,00
37.111	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	10.546	0,00
63.800	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(51.200)	Krispy Kreme Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.090.705	Kroger Co	Morgan Stanley	30.766	0,00
218.111	Kroger Co	Goldman Sachs International	9.711	0,00
6.100	K's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.495	0,00
1.761.856	Kuehne + Nagel International AG	Goldman Sachs International	1.867	0,00
(6.100)	Kulicke & Soffa Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	45	0,00
(10.800)	Kuraray Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	973	0,00
519.292	Kymera Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	30.604	0,00
41.743	Kymera Therapeutics Inc	Morgan Stanley	844	0,00
73.464	Kymera Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	6.376	0,00
83.600	Kyndryl Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	Kyocera Corp	Bank of America Merrill Lynch	607	0,00
1.596.853.401	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Société Générale	0	0,00
23.500	Kyushu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.693	0,00
(20.419)	L3Harris Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.400	Laboratory Corp of America Holdings	Morgan Stanley	0	0,00
74.900	Ladder Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.100)	Lakeland Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
55.989	Lam Research Corp	Morgan Stanley	4.335	0,00
348.410	Lam Research Corp	JPMorgan Chase Bank	15.485	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
493.228	Lam Research Corp	Goldman Sachs International	21.515	0,00
(60.731)	Lamar Advertising Co Class A	Morgan Stanley	732	0,00
(1.935.421)	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs International	485.113	0,02
(352.778)	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	51.928	0,00
1.100	Lancaster Colony Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.397)	Land Securities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.155	0,00
(6.000)	Landstar System Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(283.907)	Lantheus Holdings Inc	Morgan Stanley	15.737	0,00
(2.200)	Laredo Petroleum Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.654.921)	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	126.446	0,00
(1.741.594)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs International	228.238	0,01
(1.854.852)	Las Vegas Sands Corp	JPMorgan Chase Bank	362.475	0,01
(31.897.260)	Lasertec Corp	Goldman Sachs International	5.447	0,00
(500)	Lasertec Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.795	0,00
19.200	Lattice Semiconductor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
92.300	Laureate Education Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(891.140)	Lazard Growth Acquisition Corp I	Goldman Sachs International	0	0,00
136.982	Lazard Ltd Class A	Morgan Stanley	11.585	0,00
28.500	La-Z-Boy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.900)	LCI Industries	Morgan Stanley	0	0,00
(12.619)	Lear Corp	Morgan Stanley	0	0,00
65.486	Learning Technologies Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.547	0,00
118.300	Legalzoom.com Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(55.631)	Legend Biotech Corp	Morgan Stanley	13.982	0,00
(12.363)	Legend Biotech Corp	Goldman Sachs International	1.139	0,00
(472.596)	Legend Biotech Corp	JPMorgan Chase Bank	55.201	0,00
26.000	Leggett & Platt Inc	Morgan Stanley	0	0,00
39.488	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(21.100)	Lemonade Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	LendingClub Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.600	Lennar Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
7.900	Lennar Corp Class B	Morgan Stanley	0	0,00
2.213.841	Lennox International Inc	Goldman Sachs International	122.659	0,01
1.294.639	Lennox International Inc	Morgan Stanley	110.683	0,01
2.280.736	Lennox International Inc	JPMorgan Chase Bank	134.999	0,01
(680.144)	Leonardo SpA	Goldman Sachs International	2.075	0,00
4.600	Leopalace21 Corp	Bank of America Merrill Lynch	316	0,00
(82.700)	Leslie's Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.200	Levi Strauss & Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(16.500)	LGI Homes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.900)	LHC Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
3.899.635	Li Auto Inc	JPMorgan Chase Bank	9.100	0,00
(37.829)	Liberty Broadband Corp Class C	Goldman Sachs International	183	0,00
(537.399)	Liberty Broadband Corp Class C	Morgan Stanley	11.997	0,00
(50.527)	Liberty Broadband Corp Class C	JPMorgan Chase Bank	882	0,00
(17.000)	Liberty Broadband Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(36.686)	Liberty Broadband Corp Class C	Morgan Stanley	0	0,00
26.400	Liberty Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
309.466	Liberty Global Plc Class A	JPMorgan Chase Bank	2.038	0,00
16.200	Liberty Global Plc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
40.400	Liberty Global Plc Class C	Morgan Stanley	0	0,00
131.900	Liberty Latin America Ltd Class C	Morgan Stanley	0	0,00
31.000	Liberty Media Corp Liberty Formula One Class C	Morgan Stanley	0	0,00
27.900	Liberty Media Corp Liberty SiriusXM Class A	Morgan Stanley	0	0,00
46.100	Liberty Media Corp Liberty SiriusXM Class C	Morgan Stanley	0	0,00
10.500	Liberty Media Corp-Liberty Formula One Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(857.217)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One Class C	Morgan Stanley	16.841	0,00
(159.200)	Li-Cycle Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.400	Life Storage Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.100	Ligand Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(114.248)	Lightwave Logic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.800)	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
91.200	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(29.778)	Linde Plc	Morgan Stanley	36.749	0,00
(4.000)	Lindsay Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Lion Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.012	0,00
131.300	Lions Gate Entertainment Corp Class B	Morgan Stanley	0	0,00
7.770	Liontrust Asset Management Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.380	0,00
(34.840)	Lithia Motors Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.500)	Lithia Motors Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.500)	LivaNova Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	Live Nation Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.300)	Live Oak Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
34.000	Livent Corp	Morgan Stanley	0	0,00
19.000	LivePerson Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(25.000)	LiveRamp Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	LKQ Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.927)	Lockheed Martin Corp	Morgan Stanley	0	0,00
21.400	Loews Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(11.845)	London Stock Exchange Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	53.900	0,00
(12.033)	LondonMetric Property Plc	Bank of America Merrill Lynch	365	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
824.368	Lonza Group AG	JPMorgan Chase Bank	96.064	0,01
119.234	Lonza Group AG	Goldman Sachs International	12.862	0,00
97.684	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(789.414)	Lowe's Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	1.564	0,00
9.669	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.800	Loyalty Ventures Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.800	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
18.100	LSB Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.339.827	LTC Properties Inc	Goldman Sachs International	8.522	0,00
11.100	LTC Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.085.968	Lucid Group Inc	Morgan Stanley	545.878	0,02
1.896.201	Lucid Group Inc	Goldman Sachs International	1.123.913	0,04
1.230.743	Lucid Group Inc	JPMorgan Chase Bank	457.697	0,02
(607.749)	Luckin Coffee Inc	Morgan Stanley	79.962	0,00
(7.931.877)	Lululemon Athletica Inc	JPMorgan Chase Bank	17.811	0,00
13.900	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	0	0,00
396.292	Lumen Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(154.500)	Lumen Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.300	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.600.224	Luminar Technologies Inc	Goldman Sachs International	59.203	0,00
(254.874)	Luminar Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
299.161	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Goldman Sachs International	4.868	0,00
298.973	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	JPMorgan Chase Bank	3.218	0,00
(5.091.750)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Morgan Stanley	0	0,00
(64.700)	LXP Industrial Trust	Morgan Stanley	0	0,00
78.212	Lyft Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	14.244	0,00
3.963.401	Lyft Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(20.001)	LyondellBasell Industries NV Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(598.655)	LyondellBasell Industries NV Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	M&A Capital Partners Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	104	0,00
139.018	M&T Bank Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.424)	M&T Bank Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(16.700)	M/I Homes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
69.700	Macerich Co	Morgan Stanley	0	0,00
700	Macnica Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	257	0,00
15.600	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.700)	Macy's Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.000	Madison Square Garden Entertainment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.400)	Madison Square Garden Sports Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(539.886)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	159.809	0,01
1.621.260	Magellan Midstream Partners LP	JPMorgan Chase Bank	47.623	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(9.600)	Magellan Midstream Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
1.244.485	Magellan Midstream Partners LP	Goldman Sachs International	31.065	0,00
42.600	Magnite Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(44.200)	Magnolia Oil & Gas Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(13.000)	MakeMyTrip Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(7.500)	Malibu Boats Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(74.255)	Man Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.943	0,00
5.200	Mandom Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.083	0,00
(2.700)	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.500)	ManpowerGroup Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(134.231)	Marathon Digital Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
137.624	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.800)	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	0	0,00
12.500	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	0	0,00
7.300	Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	Marcus & Millichap Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	Markel Corp	Morgan Stanley	0	0,00
189.642	MarketAxess Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	3.456	0,00
3.500	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(116.465)	Marks & Spencer Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	901	0,00
(125.900)	Marqeta Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
2.637.775	Marriott International Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	41.566	0,00
17.900	Marriott International Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
3.310.360	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.400)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.900)	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	50.270	0,00
25.100	Marten Transport Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
900	Martin Marietta Materials Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.300	Maruha Nichiro Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.483	0,00
8.500	Marui Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.285	0,00
325.608	Marvell Technology Inc	JPMorgan Chase Bank	15.591	0,00
205.651	Marvell Technology Inc	Morgan Stanley	45.556	0,00
563.011	Marvell Technology Inc	Goldman Sachs International	69.623	0,00
(144.754)	Masco Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(466.911)	Masimo Corp	JPMorgan Chase Bank	2.154	0,00
(1.200)	Masimo Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.500)	Masonite International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.300)	MasTec Inc	Morgan Stanley	0	0,00
24.900	Masterbrand Inc	Morgan Stanley	0	0,00
188.808	Mastercard Inc Class A	Morgan Stanley	3.542	0,00
(2.500)	Matador Resources Co	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
45	Match Group Inc	JPMorgan Chase Bank	4	0,00
10.272.839	Match Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
129.381	Match Group Inc	Morgan Stanley	13.134	0,00
(6.700)	Materion Corp	Morgan Stanley	0	0,00
5.975	Mativ Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.800	Matson Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.400	Matsuda Sangyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.239	0,00
38.600	Mattel Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.605	Maxar Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
300	Maxell Ltd	Bank of America Merrill Lynch	113	0,00
(4.500)	Maxeon Solar Technologies Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(23.400)	MAXIMUS Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	MaxLinear Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
64.936	MaxLinear Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	5.132	0,00
(10.900)	Mazda Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.152	0,00
(18.700)	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.312.650)	McDonald's Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.700)	McDonald's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	McGrath RentCorp	Morgan Stanley	0	0,00
(595.907)	McKesson Corp	Goldman Sachs International	1.188	0,00
(355.755)	McKesson Corp	Morgan Stanley	8.368	0,00
(586.971)	McKesson Corp	JPMorgan Chase Bank	9.376	0,00
10.944	MDC Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.700	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
43.000	Mebuki Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.317	0,00
(105.400)	Medical Properties Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
900	Medifast Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.700	Medipal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.069	0,00
2.713.025	Medpace Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	23.045	0,00
751.713	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs International	36.091	0,00
7.700	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
30.400	Medtronic Plc	Morgan Stanley	0	0,00
75.891	Medtronic Plc	JPMorgan Chase Bank	6.075	0,00
42.297	Medtronic Plc	Goldman Sachs International	2.325	0,00
(1.000)	Meiko Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.786	0,00
2.772.715	Meituan Class B	Société Générale	0	0,00
(239.893)	Melco Resorts & Entertainment Ltd	Morgan Stanley	160.157	0,01
(7.979)	Melrose Industries Plc	JPMorgan Chase Bank	1.124	0,00
(23.059)	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs International	8.525	0,00
127.186.600	Menicon Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(4.300)	Menicon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.896	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
2.200	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.000	Mercer International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(709.277)	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	11.644	0,00
(1.743.619)	Merck & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	11.183	0,00
(6.537.623)	Merck & Co Inc	Goldman Sachs International	118.861	0,00
26.500	Mercury General Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(600)	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(443.570)	Meridian Bioscience Inc	Goldman Sachs International	16.839	0,00
(25.400)	Meridian Bioscience Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.500	Merit Medical Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(21.800)	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	0	0,00
900	Mesa Laboratories Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.679.262)	Meta Platforms Inc Class A	Morgan Stanley	113.582	0,00
(964.552)	Meta Platforms Inc Class A	Goldman Sachs International	60.936	0,00
(362.944)	Meta Platforms Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	17.512	0,00
(1.000)	Methode Electronics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.100)	MetLife Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.248)	Metso Outotec Oyj	JPMorgan Chase Bank	1.630	0,00
614.746	Metso Outotec Oyj	Morgan Stanley	5.095	0,00
(500)	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.406.444	Meyer Burger Technology AG	Goldman Sachs International	8.501	0,00
(2.800)	MFA Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.600	MGE Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.600)	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
30.800	MGM Resorts International	Morgan Stanley	0	0,00
(8.400)	MGP Ingredients Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.421	Micro Focus International Plc	Bank of America Merrill Lynch	30.080	0,00
(40.055)	Micro Focus International Plc	Morgan Stanley	1.733	0,00
768.275	Microchip Technology Inc	JPMorgan Chase Bank	32.217	0,00
555.277	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	29.155	0,00
(29.823.832)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs International	21.420	0,00
(2.432.209)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs International	61.706	0,00
934.550	Micron Technology Inc	JPMorgan Chase Bank	66.379	0,00
328.748	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	17.403	0,00
(952.741)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	4.927	0,00
(161.681)	Microsoft Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(625.272)	Microsoft Corp	JPMorgan Chase Bank	5.213	0,00
(8.200)	Mid-America Apartment Communities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.306.020)	Middleby Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.500)	Middlesex Water Co	Morgan Stanley	0	0,00
800	Milbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.982	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(17.588)	MillerKnoll Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(200)	Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	257	0,00
(5.600)	Minebea Mitsumi Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.142	0,00
(18.000)	Minerals Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.800)	Mister Car Wash Inc	Morgan Stanley	0	0,00
300	MISUMI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	107	0,00
(40.390)	Mitie Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.323	0,00
6.000	Mitsubishi Chemical Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	13	0,00
3.300	Mitsubishi Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.198	0,00
(11.300)	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.004	0,00
(3.700)	Mitsubishi Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.717	0,00
1.700	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	147	0,00
(2.700)	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	492	0,00
(100)	Miura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	44	0,00
11.000	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.195	0,00
(5.943)	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.300)	Model N Inc	Morgan Stanley	0	0,00
298.379	Moderna Inc	JPMorgan Chase Bank	6.156	0,00
707.826	Moderna Inc	Goldman Sachs International	39.788	0,00
(31.800)	Modine Manufacturing Co	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	ModivCare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Moelis & Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.000)	Mohawk Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
125.625.668	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	JPMorgan Chase Bank	2.072	0,00
1.210.792	Molina Healthcare Inc	JPMorgan Chase Bank	26.587	0,00
(1.277.130)	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs International	25.923	0,00
(4.600)	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.000)	Molson Coors Beverage Co Class B	Morgan Stanley	0	0,00
794.072	Molson Coors Beverage Co Class B	Goldman Sachs International	10.203	0,00
25.570	Molten Ventures Plc	Bank of America Merrill Lynch	13.657	0,00
96.100	Momentive Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.000	Monarch Casino & Resort Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(19.400)	Monday.com Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
735.634	Mondelez International Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	2.192	0,00
(1.125.478)	Mondelez International Inc Class A	Morgan Stanley	98.963	0,00
(102.684)	Mondi Plc	Goldman Sachs International	13.205	0,00
(115.525)	MoneyGram International Inc	Goldman Sachs International	7.625	0,00
(113.700)	MoneyGram International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
70.764	Moneysupermarket.com Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.770	0,00
(11.500)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	Monogatari Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.636	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
2.194.361	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	100.363	0,00
1.547.008	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs International	78.740	0,00
1.642.785	Monolithic Power Systems Inc	JPMorgan Chase Bank	94.827	0,00
14.500	Monro Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(840.406)	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs International	122.270	0,01
17.100	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	0	0,00
31.025	Montauk Renewables Inc	Morgan Stanley	33	0,00
(14.300)	Montrose Environmental Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.700)	Moody's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.800	Moog Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.300)	Morgan Stanley	Morgan Stanley	0	0,00
1.722.492	Morgan Stanley	Goldman Sachs International	39.740	0,00
(5.700)	Morningstar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(131.036)	Morphic Holding Inc	Goldman Sachs International	19.215	0,00
(33.691)	Mosaic Co	Morgan Stanley	0	0,00
(429.400)	Motorola Solutions Inc	JPMorgan Chase Bank	62.457	0,00
(2.900)	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
153.754	MP Materials Corp	JPMorgan Chase Bank	3.481	0,00
277.886	MP Materials Corp	Goldman Sachs International	5.487	0,00
30.439	MP Materials Corp	Morgan Stanley	531	0,00
(2.300)	MPLX LP	Morgan Stanley	0	0,00
10.400	Mr Cooper Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.736.904	Mr Price Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	30.106	0,00
1.323.981	Mr Price Group Ltd	Morgan Stanley	11.749	0,00
12.749.380	Mr Price Group Ltd	Goldman Sachs International	61.655	0,00
30.800	MRC Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.500)	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.000)	MSC Industrial Direct Co Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.900)	MSCI Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(41.617)	MTU Aero Engines AG	Morgan Stanley	88.805	0,00
(2.700)	Mueller Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
57.800	Mueller Water Products Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(300)	Murata Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	214	0,00
54.000	Murphy Oil Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.382.416)	Murphy USA Inc	Goldman Sachs International	266.499	0,01
1.800	MYR Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16	N-able Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
8.000	Nabors Industries Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
1.100	Nagase & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10	0,00
387.241.866	Nagoya Railroad Co Ltd	Société Générale	0	0,00
1.700	Nakanishi Inc	Bank of America Merrill Lynch	572	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1.600)	Napco Security Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(19.900)	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(37.715.123)	Naspers Ltd	Goldman Sachs International	341.006	0,01
(5.480.174)	Naspers Ltd	JPMorgan Chase Bank	19.222	0,00
1.400	National Bank Holdings Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
13.700	National Beverage Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.759)	National Express Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.817	0,00
608.512	National Fuel Gas Co	JPMorgan Chase Bank	11.928	0,00
825.590	National Fuel Gas Co	Morgan Stanley	25.444	0,00
497.216	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs International	62	0,00
(51.498)	National Grid Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.318	0,00
2.678.968	National Health Investors Inc	Goldman Sachs International	143.270	0,01
24.600	National Health Investors Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.100)	National Instruments Corp	Morgan Stanley	0	0,00
20.200	National Retail Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
53.200	National Storage Affiliates Trust	Morgan Stanley	0	0,00
43.300	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.700.000	NatWest Group Plc	Société Générale	564.411	0,02
7.900	Navient Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.700)	NBT Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(26.000)	nCino Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(72.800)	NCR Corp	Morgan Stanley	0	0,00
76.600	Necessity Retail REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.100)	Nelnet Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(52.093)	Neobo Fastigheter AB	Morgan Stanley	87.967	0,00
(10.600)	Neogen Corp	Morgan Stanley	0	0,00
98.900	NeoGenomics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(76.503)	Nestle SA	Goldman Sachs International	27.635	0,00
743.502	Nestle SA	JPMorgan Chase Bank	32.941	0,00
34.200	NetApp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
195.984	Netflix Inc	JPMorgan Chase Bank	6.431	0,00
265.694	Netflix Inc	Morgan Stanley	8.255	0,00
(2.800)	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(20.000)	NETSTREIT Corp	Morgan Stanley	0	0,00
5.000	Nevro Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(910.000)	New Energy One Acquisition Corp Plc	UBS AG	0	0,00
(8.200)	New Fortress Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	194	0,00
(462.726)	New Oriental Education & Technology Group Inc	Morgan Stanley	11.059	0,00
(11.800)	New Relic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
86.432	New York Community Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
519.391	Newell Brands Inc	Goldman Sachs International	191.637	0,01
63.900	Newmark Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.100)	NewMarket Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.620.000)	Newmont Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(23.800)	Newmont Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(82.900)	News Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(49.400)	News Corp Class B	Morgan Stanley	0	0,00
(1.602.916)	Nexi SpA	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.100)	NexPoint Residential Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	Nexstar Media Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.801	Next Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.014	0,00
(13.485)	Next Plc	Goldman Sachs International	1.622	0,00
2.100	Nextage Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	570	0,00
(81.760)	NextEra Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	179	0,00
47.016	NextEra Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(618.659)	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs International	40.489	0,00
2.811.272	NextEra Energy Partners LP	Nomura	0	0,00
9.000.000	NextEra Energy Partners LP	Goldman Sachs International	21.420	0,00
(6.200)	NextEra Energy Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
(40.703)	NextGen Healthcare Inc	Goldman Sachs International	4.618	0,00
(14.100)	NextGen Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(85.164)	NextTier Oilfield Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
143.600	NGM Biopharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.900	NH Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.491	0,00
(12.200)	NHK Spring Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.117	0,00
900	Nifco Inc	Bank of America Merrill Lynch	299	0,00
100	Nihon Kohden Corp	Bank of America Merrill Lynch	71	0,00
(605.829)	NIKE Inc Class B	Morgan Stanley	35.821	0,00
(2.173.507)	NIKE Inc Class B	Goldman Sachs International	138.688	0,01
(3.257.000)	NIKE Inc Class B	JPMorgan Chase Bank	75.735	0,00
(88)	Nikola Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.347.205	Nikon Corp	Morgan Stanley	888	0,00
8.366.950	Nikon Corp	JPMorgan Chase Bank	1.966	0,00
11.058.386	Nikon Corp	Goldman Sachs International	7.226	0,00
9.867.687	Nintendo Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	3.524	0,00
1.900	Nintendo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	54	0,00
8.072.559	Nintendo Co Ltd	Morgan Stanley	2.495	0,00
13.048.464	Nintendo Co Ltd	Goldman Sachs International	2.480	0,00
999.562	NIO Inc	Morgan Stanley	127.554	0,01
157.350	NIO Inc	JPMorgan Chase Bank	17.700	0,00
(1.100)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	646	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
200	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	Bank of America Merrill Lynch	1.168	0,00
(7.000)	Nippon Kayaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	149	0,00
1.600	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	244	0,00
(22.600)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.354	0,00
900	Nippon Soda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.806	0,00
958.783.500	Nippon Steel Corp	Société Générale	0	0,00
1.900	Nippon Steel Trading Corp	Bank of America Merrill Lynch	62.243	0,00
26.300	Nippon Television Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.495	0,00
65.079.000	Nipro Corp	Société Générale	0	0,00
(459.184)	NiSource Inc	JPMorgan Chase Bank	4.645	0,00
463.830	NiSource Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Nissan Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.891	0,00
14.400	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	14.526	0,00
5.600	Nisshinbo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	252	0,00
3.400	Nissui Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.154	0,00
5.400	Nitto Boseki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	827	0,00
(200)	Nitto Denko Corp	Bank of America Merrill Lynch	318	0,00
6.400	NMI Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
40.623	NN Group NV	Goldman Sachs International	0	0,00
(227.253)	Noble Corp Plc	JPMorgan Chase Bank	4.388	0,00
(34.200)	Noble Corp Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.200)	NOF Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.615	0,00
1.300	Nojima Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.138	0,00
8.900	NOK Corp	Bank of America Merrill Lynch	231	0,00
38.300	Nomad Foods Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
37.700	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.090	0,00
(3.600)	Nordson Corp	Morgan Stanley	0	0,00
17.700	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.000)	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Noritsu Koki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11.507	0,00
700	North Pacific Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22	0,00
12.600	Northern Oil & Gas Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.000	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(21.592)	Northrop Grumman Corp	Morgan Stanley	0	0,00
46.200	Northwest Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.100	Northwest Natural Holding Co	Morgan Stanley	0	0,00
(2.000)	NorthWestern Corp	Morgan Stanley	0	0,00
58.344	NortonLifeLock Inc	JPMorgan Chase Bank	3.019	0,00
25.497	NortonLifeLock Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
285.580	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs International	37.828	0,00
291.380	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	14.028	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(5.600)	NOV Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	Novanta Inc	Morgan Stanley	0	0,00
665.130	Novartis AG	Goldman Sachs International	963	0,00
(17.768.440)	Novo Nordisk A/S Class B	JPMorgan Chase Bank	417.176	0,02
(6.078.377)	Novo Nordisk A/S Class B	Morgan Stanley	61.501	0,00
(9.211.420)	Novo Nordisk A/S Class B	Goldman Sachs International	296.688	0,01
(15.200)	Novocure Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(21.900)	NOW Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(31.600)	NRG Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.100	NS Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	368	0,00
1.600	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.635	0,00
34.800	NSK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	282	0,00
(15.000)	NTN Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.705	0,00
400	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	74	0,00
(13.400)	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
3.600	Nucor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(17.100)	NuStar Energy LP	Morgan Stanley	0	0,00
(4.200)	Nutanix Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
7.600	NuVasive Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	NV5 Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.300	nVent Electric Plc	Morgan Stanley	0	0,00
365.076	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	24.276	0,00
612.293	NVIDIA Corp	JPMorgan Chase Bank	57.713	0,00
(37.935)	NVIDIA Corp	Goldman Sachs International	91	0,00
300	NVR Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.740.095	NXP Semiconductors NV	Morgan Stanley	45.633	0,00
321.309	NXP Semiconductors NV	Goldman Sachs International	14.472	0,00
46.091	Oak Street Health Inc	Goldman Sachs International	1.667	0,00
(27.100)	Oak Street Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.339)	Oatly Group AB	Morgan Stanley	11.187	0,00
(3.497)	Oatly Group AB	Goldman Sachs International	46	0,00
(29.026)	Oatly Group AB	JPMorgan Chase Bank	20.577	0,00
(19.576)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	9.810	0,00
6.989.907	Ocado Group Plc	Société Générale	22.998	0,00
23.138	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.700	Oceaneering International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.100	OceanFirst Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(85.479)	OCI NV	Morgan Stanley	1.636	0,00
(700)	ODP Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(42.100)	Office Properties Income Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(3.000)	OFG Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(29.200)	OGE Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
16.200	O-I Glass Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.397.892	Okta Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(199.600)	Olaplex Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.800)	Old Dominion Freight Line Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.005	Old National Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(47.400)	Old Republic International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.100)	Olin Corp	Morgan Stanley	0	0,00
16.100	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(105.164)	Omega Healthcare Investors Inc	Goldman Sachs International	7.460	0,00
11.100	Omniceil Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.200)	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(24.000)	On Holding AG Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(22.700)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(238.783)	ON Semiconductor Corp	JPMorgan Chase Bank	6.636	0,00
24.700	ONE Gas Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.400	OneMain Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(31.500)	ONEOK Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.000	Onto Innovation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(43.000)	Open Lending Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(17.800)	Option Care Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Optorum Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	43	0,00
(153.432)	Oracle Corp	JPMorgan Chase Bank	2.961	0,00
(625.609)	Oracle Corp	Morgan Stanley	23.232	0,00
600	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.838.229)	O'Reilly Automotive Inc	JPMorgan Chase Bank	45.100	0,00
(2.053.008)	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs International	62.998	0,00
(55.800)	Organon & Co	Morgan Stanley	0	0,00
8.650	Orient Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.003	0,00
10.200	Orion Engineered Carbons SA	Morgan Stanley	0	0,00
(20)	Orion Office REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	ORIX Corp	Bank of America Merrill Lynch	260	0,00
7.063.554	Ormat Technologies Inc	Nomura	0	0,00
(15.300)	Ormat Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.735.544	Orsted A/S	JPMorgan Chase Bank	2.689	0,00
560.599	Orsted A/S	Morgan Stanley	27.743	0,00
3.998.838	Orsted A/S	Goldman Sachs International	3.368	0,00
(1.200)	Osaka Soda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.402	0,00
(12.594)	OSB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	102	0,00
94	Oscar Health Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	OSG Corp	Bank of America Merrill Lynch	293	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
21.900	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.600	OSI Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
123.374	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.800)	Otter Tail Corp	Morgan Stanley	412	0,00
17.200	Outfront Media Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(46.415)	Outotec Oyj	Morgan Stanley	6.121	0,00
13.200	Outset Medical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.900)	Overstock.com Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(19.100)	Ovintiv Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(479.622)	Owens & Minor Inc	JPMorgan Chase Bank	65.030	0,00
(13.700)	Owens & Minor Inc	Morgan Stanley	0	0,00
64.724	Owens Corning	Morgan Stanley	0	0,00
11.400	Owl Rock Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.800	Oxford Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.079.557	PACCAR Inc	Goldman Sachs International	20.305	0,00
2.554.176	PACCAR Inc	JPMorgan Chase Bank	110.021	0,01
2.719.255	PACCAR Inc	Morgan Stanley	66.132	0,00
(5.000)	Pacific Biosciences of California Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.800	Pacific Premier Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
45.449	Pacira BioSciences Inc	Morgan Stanley	888	0,00
348.773	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs International	79.373	0,00
558.445	Pacira BioSciences Inc	JPMorgan Chase Bank	156.770	0,01
(4.300)	Packaging Corp of America	Morgan Stanley	0	0,00
(38.700)	PacWest Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.600)	PagerDuty Inc	Morgan Stanley	0	0,00
32.300	PageSeguro Digital Ltd Class A	Morgan Stanley	0	0,00
130.700	Palantir Technologies Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.190.059	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Palomar Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.300	Panasonic Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	113	0,00
(9.900)	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.100	Par Pacific Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.500)	PAR Technology Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(73.500)	Paramount Global Class B	Morgan Stanley	0	0,00
49.600	Paramount Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
35.000	Park Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.541	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	0	0,00
19.000	Parsons Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(19.200)	Pathward Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.700)	Patrick Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.980	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs International	168	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
126.102	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	2.659	0,00
61.900	Patterson-UTI Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.500	Paychex Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.000	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	0	0,00
800	Paycor HCM Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.800	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
71.000	Payoneer Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(230.644)	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	486	0,00
(947.674)	PayPal Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	3.666	0,00
15.508	PBF Energy Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
10.700	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.300	Pebblebrook Hotel Trust	Morgan Stanley	0	0,00
5.500	Pediatrix Medical Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.300)	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
86.000	Peloton Interactive Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
54.500	Penn Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
33.445	Pennon Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	733	0,00
(9.900)	PennyMac Financial Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
95.700	PennyMac Mortgage Investment Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(41.667)	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.239.265	Pentair Plc	Morgan Stanley	32.944	0,00
26.500	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.026	0,00
142.980	Penumbra Inc	JPMorgan Chase Bank	1.689	0,00
(12.300)	Penumbra Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(901.118)	PepsiCo Inc	Goldman Sachs International	85.396	0,00
(730.939)	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	45.349	0,00
(10.200)	Perdoceo Education Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.200)	Perficient Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.900)	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	0	0,00
(51.900)	Perimeter Solutions SA	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	Perion Network Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
444.506	PerkinElmer Inc	JPMorgan Chase Bank	1.647	0,00
(12.100)	PerkinElmer Inc	Morgan Stanley	0	0,00
35.919	Permian Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(16.800)	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	0	0,00
100	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2	0,00
50.300	Petco Health & Wellness Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.750)	Pets at Home Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	302	0,00
(74.900)	Pfizer Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.268.027)	PG&E Corp	JPMorgan Chase Bank	10.608	0,00
(182.196)	PG&E Corp	Morgan Stanley	466	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(30.800)	PG&E Corp	Morgan Stanley	0	0,00
10.200	PGT Innovations Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.500)	Phillips 66	Morgan Stanley	0	0,00
(21.000)	Phillips Edison & Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.947	Phoenix Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.428	0,00
(13.100)	Photronics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.200	Phreesia Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.776.477	Physicians Realty Trust	Goldman Sachs International	11.086	0,00
1.300	Physicians Realty Trust	Morgan Stanley	25	0,00
1.216.971	Pick n Pay Stores Ltd	Goldman Sachs International	5.011	0,00
3.241.506	Pick n Pay Stores Ltd	Morgan Stanley	13.066	0,00
6.567.641	Pick n Pay Stores Ltd	JPMorgan Chase Bank	4.458	0,00
(2.000)	Piedmont Lithium Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.600	Piedmont Office Realty Trust Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(57.800)	Pilgrim's Pride Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.200	Pilot Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.426	0,00
9.800	Pinnacle Financial Partners Inc	Morgan Stanley	0	0,00
18.200	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	Pinterest Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.344.727	Pioneer Natural Resources Co	JPMorgan Chase Bank	119.322	0,01
1.135.187	Pioneer Natural Resources Co	Morgan Stanley	118.899	0,01
(4.400)	Piper Sandler Cos	Morgan Stanley	0	0,00
2.625.898	Pirelli & C SpA	Goldman Sachs International	1.241	0,00
(777.659)	PJT Partners Inc Class A	Goldman Sachs International	25.202	0,00
(272.790)	PJT Partners Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	961	0,00
11.400	PJT Partners Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
10.600	Plains All American Pipeline LP	Morgan Stanley	0	0,00
1.143.182	Plains GP Holdings LP Class A	Morgan Stanley	33.199	0,00
(5.677.124)	Planet Fitness Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	481.057	0,02
9.200	Planet Fitness Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(59.700)	Planet Labs PBC	Morgan Stanley	0	0,00
(21.800)	Playa Hotels & Resorts NV	Morgan Stanley	0	0,00
27.670	Playtech Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.279	0,00
120.840	Playtika Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.500)	Plexus Corp	Morgan Stanley	0	0,00
16.500	Pliant Therapeutics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.306	Plug Power Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.337	Plus500 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	28.339	0,00
(500)	PNC Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(597.747)	PNM Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	37.430	0,00
16.500	PNM Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(58.701)	Point Biopharma Global Inc	Goldman Sachs International	17.371	0,00
427.972	Polaris Inc	Morgan Stanley	29.172	0,00
65.161	Polymetal International Plc	Morgan Stanley	1.430	0,00
(6.562)	Pool Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.900)	Popular Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.200)	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	0	0,00
16.000.000	POSCO Holdings Inc	Société Générale	17.866	0,00
21.100.000	Poseidon Finance 1 Ltd	Goldman Sachs International	26.269	0,00
3.500	Poshmark Inc Class A	Morgan Stanley	188	0,00
15.900	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.587.740)	Postal Savings Bank of China Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(6.636.840)	Postal Savings Bank of China Co Ltd	Nomura	0	0,00
17.700	PotlatchDeltic Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.800)	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(34.800)	PowerSchool Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.962.017)	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	JPMorgan Chase Bank	123.005	0,01
(4.900)	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(56.525)	PPL Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
67.700	PPL Corp	Morgan Stanley	4.830	0,00
(19.500)	PRA Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.600)	Premier Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(14.800)	Prestige Consumer Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.500)	PriceSmart Inc	Morgan Stanley	0	0,00
159.710	Primary Health Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	13.480	0,00
12.927	Primavera Capital Group	Morgan Stanley	3.877	0,00
6.200	Primerica Inc	Morgan Stanley	0	0,00
24.900	Primoris Services Corp	Morgan Stanley	0	0,00
18.700	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
27.700	ProAssurance Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(18.500)	PROCEPT BioRobotics Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(23.300)	Procore Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(774.329)	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs International	90.789	0,00
(88.226)	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	14.581	0,00
(33.300)	PROG Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.400)	Progress Software Corp	Morgan Stanley	0	0,00
18.600	Progressive Corp	Morgan Stanley	0	0,00
34.900	Progyny Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(28.045)	Prologis Inc	Morgan Stanley	0	0,00
21.312	ProPetro Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
900	PROS Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
42.047	ProSiebenSat.1 Media SE	Goldman Sachs International	1.694	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(200)	Prosperity Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
148.900	Proterra Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.900	Proto Labs Inc	Morgan Stanley	0	0,00
28.500	Provident Financial Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
281.103	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Prudential Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(438.749)	Prudential Plc	Morgan Stanley	56.683	0,00
(345.431)	Prudential Plc	JPMorgan Chase Bank	20.380	0,00
(149.202)	Prudential Plc	Goldman Sachs International	10.402	0,00
311.362	Prysmian SpA	Goldman Sachs International	16.681	0,00
3.800.000	Prysmian SpA	Société Générale	678.470	0,02
(176.823)	PTC Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	1.147	0,00
5.000	PTC Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(55.200)	Public Service Enterprise Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.300)	Public Storage	Morgan Stanley	0	0,00
(13.100)	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.575.291	Pure Storage Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.940	PureCycle Technologies Inc	Morgan Stanley	2.194	0,00
(3.000)	PVH Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.500	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.400	QIAGEN NV	Morgan Stanley	0	0,00
49.814	QinetiQ Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.197	0,00
(578.174)	Qorvo Inc	Goldman Sachs International	42.224	0,00
(1.156.057)	Qorvo Inc	JPMorgan Chase Bank	92.001	0,00
20.300	Qorvo Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.700)	Quaker Chemical Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(949.552)	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs International	12.061	0,00
28.600	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(21.100)	Qualtrics International Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
19.300	Qualys Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.507	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(176.530)	QuantumScape Corp	Morgan Stanley	2.374	0,00
185.686	QuantumScape Corp	JPMorgan Chase Bank	98.992	0,01
136.765	QuantumScape Corp	Goldman Sachs International	71.670	0,00
2.400	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.575	QuidelOrtho Corp	Morgan Stanley	93.426	0,00
(138.172)	Quilter Plc	Bank of America Merrill Lynch	17.591	0,00
(375.965)	QuinStreet Inc	Morgan Stanley	10.318	0,00
5.800	R1 RCM Holdco Inc	Morgan Stanley	14.955	0,00
(186.718)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	33.098	0,00
(157.057)	R1 RCM Inc	JPMorgan Chase Bank	14.411	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
8.300	Radian Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.400)	Radius Global Infrastructure Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
24.800	RadNet Inc	Morgan Stanley	0	0,00
22.900	Radware Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(65.012)	Raiffeisen Bank International AG	Morgan Stanley	5.731	0,00
(918.186)	Raiffeisen Bank International AG	JPMorgan Chase Bank	62.399	0,00
300	Rakus Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	153	0,00
3.100	Rakuten Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	216	0,00
(3.100)	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	0	0,00
38.100	Rambus Inc	Morgan Stanley	0	0,00
292.336	Randstad NV	JPMorgan Chase Bank	11.775	0,00
31.900	Range Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.100)	Ranger Oil Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
400	Rapid7 Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.750)	Raymond James Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.000	Rayonier Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.179.656	Raytheon Technologies Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(212.604)	Raytheon Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
134.319	REA Group Ltd	Morgan Stanley	18.191	0,00
(78.600)	Ready Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(13.600)	Realty Income Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(45.313)	Reata Pharmaceuticals Inc Class A	Goldman Sachs International	258	0,00
(561.008)	Reata Pharmaceuticals Inc Class A	Morgan Stanley	64.568	0,00
(228.955)	Reata Pharmaceuticals Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	19.063	0,00
400	Recruit Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	189	0,00
147.514	Recursion Pharmaceuticals Inc Class A	Morgan Stanley	19.601	0,00
316.143	Recursion Pharmaceuticals Inc Class A	Goldman Sachs International	82.957	0,00
23.300	Red Rock Resorts Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
28.804	Redde Northgate Plc	Bank of America Merrill Lynch	25.739	0,00
158.800	Redfin Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(28.532)	Redrow Plc	Bank of America Merrill Lynch	6.216	0,00
30.800	Redwood Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.106)	Regal Rexnord Corp	Morgan Stanley	0	0,00
26.000	Regency Centers Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.278.665	Regeneron Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	1.236	0,00
9.545	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	178	0,00
49.800	Regions Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Reinsurance Group of America Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	0	0,00
78.200	Relmada Therapeutics Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
52.013.500	Relo Group Inc	Société Générale	0	0,00
(5.900)	Relo Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	663	0,00
(4.569)	RELX Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.753	0,00
(1.094.511)	RELX Plc	JPMorgan Chase Bank	24.453	0,00
(32.000)	Remitly Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.400)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
4.000	Renasant Corp	Morgan Stanley	0	0,00
223.575	Renault SA	Goldman Sachs International	58.749	0,00
(1.911)	Renishaw Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.067	0,00
6.400	Rent-A-Center Inc	Morgan Stanley	0	0,00
519.403	Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs International	868	0,00
271.283	Rentokil Initial Plc	Morgan Stanley	64.385	0,00
(79.700)	Repay Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.100)	Repligen Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.500)	Republic Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
29.900	Resideo Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.200)	ResMed Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(107.319)	Resolute Forest Products Inc	Goldman Sachs International	9.879	0,00
10.900	Resolute Forest Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
21.500	Retail Opportunity Investments Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.800	Revance Therapeutics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(660.790)	REVOLUTION Medicines Inc	JPMorgan Chase Bank	23.696	0,00
465.013	Revolve Group Inc	Morgan Stanley	70.909	0,00
1.182.157	Rexel SA	Goldman Sachs International	46.428	0,00
(7.900)	Rexford Industrial Realty Inc	Morgan Stanley	0	0,00
111.886	Reynolds Consumer Products Inc	JPMorgan Chase Bank	892	0,00
(50.100)	Reynolds Consumer Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	RH	Morgan Stanley	0	0,00
(366.408)	Rheinmetall AG	Morgan Stanley	57.081	0,00
2.020	RHI Magnesita NV	Bank of America Merrill Lynch	270	0,00
600	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	99	0,00
6.855	Rightmove Plc	Goldman Sachs International	278	0,00
155.596	Rightmove Plc	JPMorgan Chase Bank	26.337	0,00
6.489	Rightmove Plc	Morgan Stanley	822	0,00
(2.800)	RingCentral Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
6.118	Rio Tinto Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.131	0,00
(256.812)	Rio Tinto Plc	Morgan Stanley	10.791	0,00
(239.337)	Rio Tinto Plc	Goldman Sachs International	12.333	0,00
(112.400)	Riot Blockchain Inc	Morgan Stanley	0	0,00
44.900	Rithm Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
590.322	Rivian Automotive Inc Class A	Morgan Stanley	76.361	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(2.000)	RLI Corp	Morgan Stanley	0	0,00
107.300	RLJ Lodging Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(8.200)	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
127.100	Robinhood Markets Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
12.200	ROBLOX Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
993.912	Roche Holding AG	Morgan Stanley	48.352	0,00
2.441.805	Roche Holding AG	Goldman Sachs International	160.810	0,01
257.143	Roche Holding AG	JPMorgan Chase Bank	4.710	0,00
(82.300)	Rocket Cos Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.879)	Rockwell Automation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(145.272)	Rockwell Automation Inc	JPMorgan Chase Bank	8.670	0,00
(61.954)	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs International	7.833	0,00
(20.880)	Rogers Communications Inc	Goldman Sachs International	1.713	0,00
(152.141)	Rogers Communications Inc	Morgan Stanley	4.450	0,00
(1.454.922)	Rogers Communications Inc	JPMorgan Chase Bank	48.136	0,00
(2.400)	Rogers Corp	Morgan Stanley	0	0,00
100	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	128	0,00
(12.000)	Roku Inc	Morgan Stanley	0	0,00
112.500	Rollins Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.223.101)	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldman Sachs International	50.210	0,00
(9.840)	Roper Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
500	Rorze Corp	Bank of America Merrill Lynch	367	0,00
(4.691.286)	Ross Stores Inc	Morgan Stanley	839.140	0,03
(1.150.801)	Ross Stores Inc	JPMorgan Chase Bank	134.992	0,01
(31.244)	Rotork Plc	Goldman Sachs International	20.406	0,00
(90.008)	Rotork Plc	JPMorgan Chase Bank	19.294	0,00
(93.627)	Rotork Plc	Morgan Stanley	32.536	0,00
72.166	Rotork Plc	Bank of America Merrill Lynch	22.635	0,00
(2.600)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
5.700	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	5.724	0,00
(300)	Royal Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	117	0,00
79.200	Royalty Pharma Plc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(81.577)	RPC Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	RPM International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.700	RPT Realty	Morgan Stanley	0	0,00
9.900	Rush Enterprises Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
31.022	RWS Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	18.652	0,00
7.128	RXO Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.000)	RXO INC	Morgan Stanley	0	0,00
10.800	Ryan Specialty Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.400	Ryder System Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
16.000	Ryerson Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.700)	Ryman Hospitality Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
263.145	S&P Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(440)	S&P Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
350.133	Saab AB Class B	Morgan Stanley	17.207	0,00
78.400	Sabra Health Care REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(177.400)	Sabre Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(24.565)	Safehold Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.405)	Safestore Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	2	0,00
(5.000)	Safety Insurance Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.218.243)	Safran SA	Morgan Stanley	315.593	0,01
7.411.737	Safran SA	Goldman Sachs International	99.068	0,00
(590.447)	Safran SA	JPMorgan Chase Bank	83.499	0,00
14.316	Saia Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.500	Sakata Seed Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.294	0,00
73.579	Salesforce Inc	JPMorgan Chase Bank	10.416	0,00
204.756	Salesforce Inc	Morgan Stanley	3.424	0,00
(2.616.272)	Salesforce Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
890.422	Sally Beauty Holdings Inc	Morgan Stanley	50.933	0,00
(51.531)	Samsara Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.073.058)	Samsung Electronics Co Ltd	Goldman Sachs International	35.689	0,00
(9.091)	Sandbridge X2 Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.080.429)	Sandvik AB	Goldman Sachs International	246.341	0,01
504.151	Sandvik AB	Morgan Stanley	8.433	0,00
2.500	Sandy Spring Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.220.872	Sanlam Ltd	JPMorgan Chase Bank	9.942	0,00
5.330.057	Sanlam Ltd	Morgan Stanley	10.524	0,00
302.992	Sanlam Ltd	Goldman Sachs International	566	0,00
(8.900)	Sanmina Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	Sansan Inc	Bank of America Merrill Lynch	783	0,00
(14.100)	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	887	0,00
4.100	Sanwa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	220	0,00
22.573	SAP SE	Goldman Sachs International	398	0,00
307.758	SAP SE	JPMorgan Chase Bank	14.882	0,00
636.357	SAP SE	Morgan Stanley	21.377	0,00
1.300	Sapporo Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1	0,00
(1.057.787)	Sarepta Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	116.405	0,01
532.234	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	12.128	0,00
(887.687)	Sarepta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	75.378	0,00
29.400.000	Sasol Financing USA LLC	Société Générale	216.972	0,01
5.398.318	Sasol Ltd	JPMorgan Chase Bank	31.472	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
7.415.843	Sasol Ltd	Société Générale	0	0,00
6.617.238	Sasol Ltd	Goldman Sachs International	30.089	0,00
864	Satellogic Inc	Morgan Stanley	188	0,00
7.200	SBA Communications Corp	Morgan Stanley	0	0,00
750.000.000	SBI Holdings Inc	Goldman Sachs International	31.377	0,00
1.675.915.148	SBI Holdings Inc	Société Générale	0	0,00
(22.500)	SBI Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.275	0,00
(500)	SBS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	313	0,00
(644.433)	Schaeffler AG	Morgan Stanley	37.312	0,00
(720.085)	Schlumberger Ltd	Morgan Stanley	46.451	0,00
(4.080.175)	Schlumberger Ltd	Goldman Sachs International	269.598	0,01
(1.555.467)	Schlumberger Ltd	JPMorgan Chase Bank	35.330	0,00
167.010	Schneider Electric SE	Goldman Sachs International	84.159	0,00
12.000	Schneider National Inc Class B	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	Schnitzer Steel Industries Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
7.380	Scholastic Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(18.737)	Schroders Plc	Bank of America Merrill Lynch	9.244	0,00
12.300	Schrodinger Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(600)	Science Applications International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.000)	Scorpio Tankers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
78.454	Scotts Miracle-Gro Co	Goldman Sachs International	2.405	0,00
(10.100)	Scotts Miracle-Gro Co	Morgan Stanley	0	0,00
(4.900)	SCSK Corp	Bank of America Merrill Lynch	210	0,00
(27.200)	Seacoast Banking Corp of Florida	Morgan Stanley	0	0,00
404.046	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs International	80.245	0,00
789.286	Seagate Technology Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	268.025	0,01
(66.535)	Seagate Technology Holdings Plc	Morgan Stanley	9.493	0,00
(386.851)	Seagen Inc	JPMorgan Chase Bank	20.926	0,00
200	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	0	0,00
393.279	SeaWorld Entertainment Inc	Morgan Stanley	1.227	0,00
300	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21	0,00
(40.182)	Segro Plc	Bank of America Merrill Lynch	17.452	0,00
22.300	SEI Investments Co	Morgan Stanley	0	0,00
(5.800)	Seiko Epson Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.520	0,00
69.044.502	Seino Holdings Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(5.800)	Seiren Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.040	0,00
28.600	Select Medical Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.500)	Sempra Energy	Morgan Stanley	0	0,00
(3.400)	Semtech Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.800	Senko Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	833	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
46.500	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.000)	Sensient Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(50.400)	SentinelOne Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(49.715)	Serica Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	26.079	0,00
17.800	Service Corp International	Morgan Stanley	0	0,00
9.400	Service Properties Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(114.234)	ServiceNow Inc	JPMorgan Chase Bank	10.080	0,00
500	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.500)	ServisFirst Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
125.200	Seven Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11.360	0,00
(4.527)	Severn Trent Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.447	0,00
22.000	SFL Corp Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
5.221	Shaftesbury Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.311	0,00
668.475	Shake Shack Inc Class A	Morgan Stanley	43.502	0,00
(10.300)	Sharp Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.333	0,00
(812.434)	Shaw Communications Inc	Goldman Sachs International	65.301	0,00
167.382	Shell Plc	Goldman Sachs International	11.765	0,00
35.715	Sherwin-Williams Co	Morgan Stanley	0	0,00
1.100	Shibaura Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	987	0,00
(300)	SHIFT Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.766	0,00
(1.162.528)	Shift4 Payments Inc Class A	Morgan Stanley	124.207	0,01
5.800	Shiga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.316	0,00
(1.600)	Shimadzu Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.133	0,00
600	Shimamura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.134	0,00
(100)	Shimano Inc	Bank of America Merrill Lynch	83	0,00
29.400	Shimizu Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.961	0,00
4.800	Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.299	0,00
179.860.208	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	47.470	0,00
(1.400)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.618	0,00
(700)	Shionogi & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	257	0,00
300	Ship Healthcare Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	84	0,00
9.200	Shizuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	21.454	0,00
20.500	Shoals Technologies Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
14.900	Shockwave Medical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
500	Shoei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	359	0,00
(156.000)	Shopify Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Shutterstock Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.200)	Shyft Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.882.575	Siemens Energy AG	Société Générale	0	0,00
24.600.000	Siemens Energy Finance BV	Société Générale	815.002	0,03
19.200	SIGA Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(8.700)	Signature Bank	Morgan Stanley	0	0,00
(3.634.840)	Signet Jewelers Ltd	Morgan Stanley	95.055	0,00
(30.500)	Signify Health Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
18.085	Sika AG	Goldman Sachs International	11.510	0,00
(4.200)	Silgan Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.000)	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	0	0,00
335.395	Silk Road Medical Inc	JPMorgan Chase Bank	4.385	0,00
181.623	Silk Road Medical Inc	Morgan Stanley	4.418	0,00
(32.900)	Silvergate Capital Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(10.000)	Simmons First National Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(13.000)	Simon Property Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(497.848)	Simply Good Foods Co	Morgan Stanley	106	0,00
(552.205)	Simply Good Foods Co	Goldman Sachs International	12.944	0,00
3.000	Simpson Manufacturing Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.900)	Simulations Plus Inc	Morgan Stanley	0	0,00
42.749	Sinclair Broadcast Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(97.200)	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(57.700)	SITE Centers Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.100	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.100)	SiTime Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.492)	Sitio Royalties Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
3.400	Six Flags Entertainment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.300)	Sixth Street Specialty Lending Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	SJW Group	Morgan Stanley	0	0,00
413.773	SK Hynix Inc	Morgan Stanley	14.271	0,00
180.343	SK Hynix Inc	JPMorgan Chase Bank	11.977	0,00
764.103	SK Hynix Inc	Goldman Sachs International	78.321	0,00
87.183	Skechers USA Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(26.500)	Skechers USA Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
4.806.683	SKF AB Class B	Morgan Stanley	51.340	0,00
6.464.385	SKF AB Class B	JPMorgan Chase Bank	122.534	0,01
16.000	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.859	0,00
12.800	Skyline Champion Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.875)	SkyWest Inc	Morgan Stanley	0	0,00
65.801	Skyworks Solutions Inc	JPMorgan Chase Bank	5.774	0,00
24.500	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.848	SL Green Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
847.785	Sleep Number Corp	JPMorgan Chase Bank	2.212	0,00
2.000	Sleep Number Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(22.800)	SLM Corp	Morgan Stanley	272	0,00
25.526	SM Energy Co	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(31.200)	SMART Global Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Smartsheet Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
20.660	Smith & Nephew Plc	Bank of America Merrill Lynch	9.757	0,00
(722.327)	Smith & Nephew Plc	Goldman Sachs International	71.817	0,00
(555.208)	Smith & Nephew Plc	JPMorgan Chase Bank	35.619	0,00
(120.273)	Smith & Nephew Plc	Morgan Stanley	2.630	0,00
200	SMS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	241	0,00
(235.442)	Smurfit Kappa Group Plc	JPMorgan Chase Bank	2.879	0,00
(182.854)	Smurfit Kappa Group Plc	Morgan Stanley	26.889	0,00
(6.300)	Snap-on Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.000	Snow Peak Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.481	0,00
(11.500)	Snowflake Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(32.273)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	Morgan Stanley	0	0,00
894	Societe Fonciere Lyonnaise SA	Morgan Stanley	0	0,00
(481.835)	Societe Generale SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(60.499.366)	Socionext Inc	JPMorgan Chase Bank	16.142	0,00
(48.601.974)	Socionext Inc	Goldman Sachs International	66.756	0,00
(228.425)	Sodexo SA	Goldman Sachs International	2.834	0,00
(940.120)	Sodexo SA	JPMorgan Chase Bank	80.076	0,00
(159.200)	SoFi Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
206.166.276	SoftBank Group Corp	Morgan Stanley	95.581	0,01
60.662.917	SoftBank Group Corp	JPMorgan Chase Bank	2.143	0,00
17.403	Softcat Plc	Bank of America Merrill Lynch	16.616	0,00
700	Sohgo Security Services Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	745	0,00
1.303.805	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.120.252)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	55.859	0,00
142.700	Solid Power Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Sompo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	14.528	0,00
(13.600)	Sonic Automotive Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(6.400)	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	Sonos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
135.301	Sonova Holding AG	JPMorgan Chase Bank	457	0,00
48.054	Sonova Holding AG	Goldman Sachs International	5.392	0,00
407.197	Sonova Holding AG	Morgan Stanley	18.600	0,00
(149.203.696)	Sony Group Corp	Goldman Sachs International	9.900	0,00
(1.000)	Sony Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.157	0,00
(3.600)	Sotera Health Co	Morgan Stanley	0	0,00
(186.096)	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs International	7.583	0,00
(24.200)	South Jersey Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
18.900	South State Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(21.700)	Southern Co	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(900)	Southern Copper Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(18.000)	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	0	0,00
17.300	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.600	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	0	0,00
29.500	Sovos Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.900	SpartanNash Co	Morgan Stanley	0	0,00
(1.278)	Spectris Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.497	0,00
(620.370)	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	87.651	0,00
(324.356)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs International	24.678	0,00
(93.421)	SPIE SA	Morgan Stanley	5.174	0,00
(132.761)	SPIE SA	Goldman Sachs International	10.680	0,00
(656.582)	SPIE SA	JPMorgan Chase Bank	90.297	0,00
(1.893)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Bank of America Merrill Lynch	18.486	0,00
(19.282)	Spire Healthcare Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	510	0,00
(1.500)	Spire Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(112.442)	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
28.300	Spirit Airlines Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.000	Spirit Realty Capital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
54.290	Splunk Inc	Goldman Sachs International	1.534	0,00
(1.800)	Splunk Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.000	S-Pool Inc	Bank of America Merrill Lynch	9	0,00
(18.500)	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	0	0,00
24.470	SpringBig Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.100)	Sprinklr Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
4.200	Sprout Social Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
102.133	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	2.700	0,00
155.913	Sprouts Farmers Market Inc	JPMorgan Chase Bank	5.714	0,00
105.639	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs International	5.506	0,00
300	SPS Commerce Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(210.854.354)	Square Enix Holdings Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	60.260	0,00
(53.379.161)	Square Enix Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	36.730	0,00
1.200	Square Enix Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.423	0,00
46.600	Squarespace Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
16.800	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
51.600	STAAR Surgical Co	Morgan Stanley	0	0,00
641.460	Stadler Rail AG	JPMorgan Chase Bank	122.839	0,01
17.400	STAG Industrial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
357.078	Standard Bank Group Ltd	Goldman Sachs International	379	0,00
7.939.602	Standard Bank Group Ltd	Morgan Stanley	15.771	0,00
15.059.701	Standard Bank Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	14.083	0,00
(2.100)	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(5.700)	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.700	0,00
(100.000)	Star Bulk Carriers Corp	Morgan Stanley	0	0,00
287.530	Starbucks Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.600)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	0	0,00
11.400	Starwood Property Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
34.100	State Street Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.000)	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
46.800	Steelcase Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
120.608	Stellantis NV	Morgan Stanley	289.664	0,01
(34.100)	Stem Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.100)	Stepan Co	Morgan Stanley	0	0,00
25.200	StepStone Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	Stericycle Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.100)	STERIS Plc	Morgan Stanley	0	0,00
5.400	Sterling Infrastructure Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.700)	Steven Madden Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(13.100)	Stewart Information Services Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.250	Stifel Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(933.701)	STMicroelectronics NV	Goldman Sachs International	0	0,00
2.203	STMicroelectronics NV	Morgan Stanley	95	0,00
389.609	STMicroelectronics NV	JPMorgan Chase Bank	20.782	0,00
(2.400)	Stock Yards Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
55.500	Stone Co Ltd Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(9.600)	StoneX Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(71.094)	STORE Capital Corp	Morgan Stanley	179	0,00
34.300	Stratasys Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(11.100)	Strategic Education Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(24.400)	Stride Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.470.011)	Stryker Corp	Goldman Sachs International	223.976	0,01
(16.000)	Stryker Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(16.400)	Sturm Ruger & Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.900)	Sugi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.757	0,00
64.447.387	SUMCO Corp	Goldman Sachs International	38.611	0,00
232.948.642	SUMCO Corp	JPMorgan Chase Bank	140.521	0,01
229.893.312	SUMCO Corp	Morgan Stanley	143.982	0,01
1.300	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	727	0,00
23.300	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.962	0,00
8.900	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	33.772	0,00
200	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	124	0,00
14.600	Sumitomo Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.977	0,00
1.800	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	630	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(13.900)	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	970	0,00
7.800	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.849	0,00
60.500	Summit Hotel Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
23.329	Summit Materials Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
45.000	Sumo Logic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.500)	Sun Communities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.000	Sun Country Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(62.425)	Sungrow Power Supply Co Ltd	Morgan Stanley	1.242	0,00
(242.765)	Sungrow Power Supply Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	81.177	0,00
806.409	Sunnova Energy International Inc	Goldman Sachs International	2.686	0,00
124.136	Sunnova Energy International Inc	Morgan Stanley	43.313	0,00
(2.200)	Sunoco LP	Morgan Stanley	0	0,00
25.500	SunOpta Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.016.829	SunPower Corp	Morgan Stanley	114.324	0,01
425.907	SunPower Corp	Goldman Sachs International	18.209	0,00
8.205	Sunrun Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(23.000)	Sunstone Hotel Investors Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	260	0,00
(34.100)	Super Micro Computer Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.900)	Supernus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.700)	Surgery Partners Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.972	Sustainable Development AC	Morgan Stanley	158	0,00
1.500	Suzuken Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	609	0,00
(11.297)	SVB Financial Group	Morgan Stanley	0	0,00
(56.200)	Sweetgreen Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
2.652.812	Swiss Re AG	Goldman Sachs International	0	0,00
7.536.089	Swiss Re AG	Société Générale	0	0,00
(21.300)	Synaptics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
37.700	Synchrony Financial	Morgan Stanley	0	0,00
(6.900)	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	Synopsis Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.800	Synovus Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.746	Synthomer Plc	Bank of America Merrill Lynch	893	0,00
390.920	Sysco Corp	Morgan Stanley	51.642	0,00
784.628	Sysco Corp	Goldman Sachs International	62.119	0,00
132.581	Sysco Corp	JPMorgan Chase Bank	12.163	0,00
(1.600)	Symex Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.586	0,00
381.763	T Rowe Price Group Inc	JPMorgan Chase Bank	10.577	0,00
(4.900)	T Rowe Price Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(76)	TAG Immobilien AG	Société Générale	0	0,00
5.500	Taiheiyo Cement Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.543	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
900	Taikisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19	0,00
(89.129)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs International	10.010	0,00
(1.300)	Taiyo Yuden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.516	0,00
13.300	Takashimaya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16.028	0,00
(529.577)	Take-Two Interactive Software Inc	Morgan Stanley	30.768	0,00
32.589	Take-Two Interactive Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.500	Takuma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.828	0,00
2.600	Talos Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.200	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25.800	Tanger Factory Outlet Centers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.596.880)	Tapestry Inc	Morgan Stanley	206.583	0,01
(1.493.060)	Tapestry Inc	JPMorgan Chase Bank	45.611	0,00
(2.084.665)	Targa Resources Corp	Morgan Stanley	235.105	0,01
(1.451.716)	Targa Resources Corp	Goldman Sachs International	46.351	0,00
16.700	Target Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.205.042	Target Corp	JPMorgan Chase Bank	78.892	0,00
(66.400)	Target Hospitality Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(400.007)	Tate & Lyle Plc	Morgan Stanley	19.224	0,00
200	Taylor Morrison Home Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.344	TBC Bank Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	130	0,00
300	TD SYNEX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
20.700	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
118.500	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	0	0,00
8.900	TechTarget Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.100)	Teekay Tankers Ltd Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(43.100)	TEGNA Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.200	Teijin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	130	0,00
(286.619)	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs International	2.576	0,00
67.400	Teladoc Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.511.323	Tele2 AB	Goldman Sachs International	44.107	0,00
844.119	Tele2 AB	Morgan Stanley	2.196	0,00
4.708.086	Tele2 AB Class B	JPMorgan Chase Bank	113.719	0,01
4.418	Telecom Plus Plc	Bank of America Merrill Lynch	494	0,00
(3.180)	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.000)	Teleflex Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(592.182)	Teleflex Inc	Goldman Sachs International	58.234	0,00
11.902	Telefonica SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.258.330)	Teleperformance	JPMorgan Chase Bank	51.325	0,00
(314.148)	Teleperformance	Morgan Stanley	12.109	0,00
62.800	Telephone & Data Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.564.215	Telia Co AB	Goldman Sachs International	29.147	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.411.183	Telia Co AB	Morgan Stanley	11.707	0,00
7.106.884	Telia Co AB	JPMorgan Chase Bank	121.372	0,01
(325.208)	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	5.161	0,00
(4.208.388)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs International	255.033	0,01
(6.263.610)	Tempur Sealy International Inc	JPMorgan Chase Bank	1.130.350	0,04
32.300	Tenable Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.800	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	0	0,00
9.100	Teradata Corp	Morgan Stanley	0	0,00
23.900	Teradyne Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.500	Terex Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.023.374	Terreno Realty Corp	Goldman Sachs International	89.640	0,00
12.300	Terreno Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
468.805	Tesla Inc	Goldman Sachs International	25.048	0,00
493.377	Tesla Inc	Morgan Stanley	77.329	0,00
2.747.097	Tesla Inc	JPMorgan Chase Bank	679.322	0,03
(5.100)	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.200	Texas Capital Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.494.135	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	33.867	0,00
(315.487)	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs International	12.132	0,00
(571.897)	Texas Instruments Inc	JPMorgan Chase Bank	44.914	0,00
(293.327)	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.400)	Textainer Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
30.300	Textron Inc	Morgan Stanley	0	0,00
46.845	Thales SA	Goldman Sachs International	2.996	0,00
4.600	Thermo Fisher Scientific Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	THK Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	62	0,00
334.269	Thor Industries Inc	Morgan Stanley	48.605	0,00
(53.600)	Thoughtworks Holding Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(71.726)	thyssenkrupp AG	Morgan Stanley	1.769	0,00
(25.000)	Tidewater Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.264.274	Timken Co	JPMorgan Chase Bank	15.788	0,00
1.197.992	Timken Co	Morgan Stanley	34.254	0,00
(1.900)	TimkenSteel Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(35.900)	Titan International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.200)	TJX Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.200	TKP Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.288	0,00
(141.853)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs International	205	0,00
(319.202)	T-Mobile US Inc	JPMorgan Chase Bank	23.850	0,00
(98.000)	Toast Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Toei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.745	0,00
700	Toho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	181	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
5.600	Toho Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.048	0,00
(2.100)	Toho Titanium Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.068	0,00
800	Token Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.100	0,00
(4.500)	Tokuyama Corp	Bank of America Merrill Lynch	517	0,00
3.000	Tokyo Century Corp	Bank of America Merrill Lynch	3	0,00
6.200	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	3	0,00
189.920.860	Tokyo Electron Ltd	Goldman Sachs International	201.820	0,01
94.716.895	Tokyo Electron Ltd	Morgan Stanley	99.064	0,00
330.588.845	Tokyo Electron Ltd	JPMorgan Chase Bank	442.880	0,02
(200)	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	922	0,00
400	Tokyotokeiba Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	305	0,00
34.800	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.900)	Tootsie Roll Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.000	TopBuild Corp	Morgan Stanley	0	0,00
400	Topcon Corp	Bank of America Merrill Lynch	52	0,00
1.900	Toridoll Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	589	0,00
(2.200)	Toro Co	Morgan Stanley	0	0,00
4.700	Toshiba Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.835	0,00
(1.128.011)	TotalEnergies SE	JPMorgan Chase Bank	60.209	0,00
(3.597.996)	TotalEnergies SE	Goldman Sachs International	14.899	0,00
(1.552.934)	TotalEnergies SE	Morgan Stanley	48.534	0,00
(1.600)	TOTO Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.685	0,00
(2.500)	Towa Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.053	0,00
(28.500)	Tower Semiconductor Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	Toyo Tire Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.140	0,00
4.200	Toyobo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	665	0,00
(13.300)	Toyota Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.665	0,00
(900)	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	561	0,00
79.334	TP ICAP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.748	0,00
15.500	TPG Inc	Morgan Stanley	0	0,00
800	Tractor Supply Co	Morgan Stanley	0	0,00
47.600	Trade Desk Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(167.674)	Tradeweb Markets Inc Class A	Goldman Sachs International	31.851	0,00
(588.524)	Tradeweb Markets Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	61.836	0,00
(722.672)	Tradeweb Markets Inc Class A	Morgan Stanley	72.159	0,00
(3.211.084)	Trane Technologies Plc	Morgan Stanley	88.821	0,00
61.175.200	Transcosmos Inc	Société Générale	0	0,00
(200)	TransDigm Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.500	TransMedics Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.300	TransUnion	Morgan Stanley	0	0,00
(18.100)	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(11.100)	Travelers Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(151.321)	Travis Perkins Plc	Goldman Sachs International	9.217	0,00
(2.900)	Treace Medical Concepts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(696.189)	TreeHouse Foods Inc	Morgan Stanley	63.265	0,00
(1.664.572)	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs International	111.894	0,01
33.300	Trex Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
57.800	Tri Pointe Homes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
41.900	Trimble Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.300	TriNet Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
49.700	Trinity Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.900	Trinseo Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(815.692)	Trip.com Group Ltd	Morgan Stanley	73.350	0,00
12.700	TripAdvisor Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(44.040)	Tritax Big Box REIT Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.278	0,00
238	Tritium DCFC Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
69.809	Tritium DCFC Ltd	JPMorgan Chase Bank	64.260	0,00
(4.000)	Triton International Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(10.800)	Triumph Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(15.700)	Tronox Holdings Plc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(12.700)	Truist Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(25.300)	Trupanion Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Trusco Nakayama Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.076	0,00
13.700	Trustmark Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.000	TS Tech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	115	0,00
800	Tsumura & Co	Bank of America Merrill Lynch	219	0,00
(10.900)	TTEC Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
18.432	TTM Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(769.485)	TUI AG	Société Générale	0	0,00
123.160	TUI AG	Bank of America Merrill Lynch	32.458	0,00
88.855	TuSimple Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
7.600	TV Asahi Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.105	0,00
(454.000)	Twelve Seas Investment Co II Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
16.416	Twelve Seas Investment Company II	Goldman Sachs International	0	0,00
15.500	Twilio Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.700)	Tyler Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.900	Tyson Foods Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
89.400	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.500.000)	Uber Technologies Inc1	Goldman Sachs International	3.656.013	0,12
3.700	Ubiquiti Inc	Morgan Stanley	0	0,00
21.644.000	UBS Group AG	Société Générale	736.103	0,03
732.177	UCB SA	Goldman Sachs International	30.221	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
43.500	Udemy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(19.800)	UDR Inc	Morgan Stanley	46.162	0,00
(15.300)	UFP Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	UFP Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.300	UGI Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	U-Haul Holding Co	Morgan Stanley	44.928	0,00
(168.300)	UiPath Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(61.869)	UK Commercial Property REIT Ltd	Bank of America Merrill Lynch	605	0,00
(428.169)	Ulta Beauty Inc	Morgan Stanley	236.992	0,01
2.344.563	Ulta Beauty Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.500)	Ultra Clean Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(731.263)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	195.010	0,01
(1.116.855)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	JPMorgan Chase Bank	286.018	0,01
(317.497)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	94.462	0,00
(2.100)	Ulvac Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.866	0,00
(5.100)	UMB Financial Corp	Morgan Stanley	307	0,00
46.595	Umicore SA	Morgan Stanley	775	0,00
(508.642)	Umpqua Holdings Corp	Goldman Sachs International	30.221	0,00
61.700	Umpqua Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
80.100	Under Armour Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
104.500	Under Armour Inc Class C	Morgan Stanley	0	0,00
(4.400)	UniFirst Corp	Morgan Stanley	0	0,00
96.665	Unilever Plc	Morgan Stanley	463	0,00
(3.700)	Union Pacific Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.204.175)	uniQure NV	JPMorgan Chase Bank	164.286	0,01
(429.739)	uniQure NV	Goldman Sachs International	78.986	0,00
(26.301)	UNITE Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	8.638	0,00
17.000	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.400)	United Bankshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	United Community Banks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
182.832	United Microelectronics Corp	JPMorgan Chase Bank	57.042	0,00
37.656	United Microelectronics Corp	Morgan Stanley	10.423	0,00
20.972	United Microelectronics Corp	Goldman Sachs International	5.734	0,00
11.400	United Natural Foods Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.554.479	United Parcel Service Inc Class B	JPMorgan Chase Bank	78.718	0,00
1.269.602	United Parcel Service Inc Class B	Morgan Stanley	73.534	0,00
1.159.056	United Parcel Service Inc Class B	Goldman Sachs International	95.398	0,01
(1.413.610)	United Rentals Inc	Morgan Stanley	51.209	0,00
(3.431.061)	United Rentals Inc	Goldman Sachs International	154.251	0,01
(1.905.976)	United Rentals Inc	JPMorgan Chase Bank	133.711	0,01
19.800	United States Cellular Corp	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(23.700)	United States Steel Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(14.936)	United Utilities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.893	0,00
(676.001)	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	1.533	0,00
(3.459.871)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs International	15.782	0,00
(1.005.189)	UnitedHealth Group Inc	JPMorgan Chase Bank	8.191	0,00
217.900	Uniti Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(66.095)	Unity Software Inc	Morgan Stanley	13.289	0,00
124.321	Unity Software Inc	Goldman Sachs International	9.216	0,00
133.740	Univar Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.700	Universal Display Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.400)	Universal Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.045	0,00
(2.773.750)	Universal Health Services Inc Class B	Morgan Stanley	228.691	0,01
(954.732)	Universal Health Services Inc Class B	JPMorgan Chase Bank	88.288	0,00
(992.936)	Universal Health Services Inc Class B	Goldman Sachs International	72.187	0,00
252.269	Unum Group	Goldman Sachs International	0	0,00
(34.500)	Upstart Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
115.300	Upwork Inc	Morgan Stanley	0	0,00
63.800	Urban Edge Properties	Morgan Stanley	0	0,00
76.249	Urban Logistics REIT Plc	Bank of America Merrill Lynch	17.735	0,00
18.700	Urban Outfitters Inc	Morgan Stanley	0	0,00
28.800	US Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.100)	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
80.398	US Physical Therapy Inc	Morgan Stanley	3.453	0,00
24.668	US Physical Therapy Inc	JPMorgan Chase Bank	339	0,00
68.759	US Silica Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.400	Usen-Next Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.391	0,00
(13.600)	UserTesting Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.000)	Ushio Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.257	0,00
(1.800)	USS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	600	0,00
(37.600)	Utz Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
584.442	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	22.293	0,00
(18.400)	Valaris Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(256.960)	Valeo	Goldman Sachs International	2.222	0,00
739.255	Valero Energy Corp	Morgan Stanley	2.940	0,00
11.600	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(168.410)	Vallourec SA	JPMorgan Chase Bank	34.666	0,00
(595.054)	Vallourec SA	Goldman Sachs International	108.033	0,01
(570.584)	Vallourec SA	Morgan Stanley	101.811	0,01
(6.500)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.100	Valor Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.751	0,00
(900)	Valvoline Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(21.300)	Varex Imaging Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(36.100)	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
26.200	Veeco Instruments Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.100	Veeva Systems Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(4.929.948)	Ventas Inc	Goldman Sachs International	1.713	0,00
(16.700)	Ventas Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(36.400)	Ventyx Biosciences Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(350.934)	Veolia Environnement SA	JPMorgan Chase Bank	12.601	0,00
(122.852)	Veolia Environnement SA	Goldman Sachs International	6.761	0,00
(158.169)	Veolia Environnement SA	Morgan Stanley	4.864	0,00
(7.400)	Verint Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.000	Veris Residential Inc	Morgan Stanley	0	0,00
349.592	VeriSign Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.100	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
18.800	Veritex Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
100	Veritiv Corp	Morgan Stanley	0	0,00
26.500	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.100)	Verra Mobility Corp	Morgan Stanley	0	0,00
182.416	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	36.511	0,00
626.857	Vertex Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	7.554	0,00
67.400	Vertiv Holdings Co	Morgan Stanley	0	0,00
(148.725)	Veru Inc	Morgan Stanley	0	0,00
259.407	Verve Therapeutics Inc	Morgan Stanley	15.058	0,00
252.429	Verve Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	14.741	0,00
(5.910.490)	Vestas Wind Systems A/S	Morgan Stanley	109.225	0,01
22.076	Vesuvius Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.875	0,00
2.591.398	VF Corp	JPMorgan Chase Bank	160.681	0,01
359.143	VF Corp	Goldman Sachs International	19.387	0,00
3.630.868	VF Corp	Morgan Stanley	281.254	0,01
3.000	Viasat Inc	Morgan Stanley	0	0,00
270.866	Viatis Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(196.400)	Viatis Inc	Morgan Stanley	0	0,00
40.100	Viavi Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
96.093	VICI Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.300	Vicor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(59.300)	Victoria's Secret & Co	Morgan Stanley	0	0,00
5.600	Victory Capital Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.700)	Viper Energy Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
(1.561.018)	Vipshop Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	102.507	0,01
1.718.707	Virgin Galactic Holdings Inc	Nomura	0	0,00
(87.500)	Virgin Galactic Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(252.716)	Virtu Financial Inc Class A	Morgan Stanley	7.286	0,00
(608.884)	Virtu Financial Inc Class A	Goldman Sachs International	10.684	0,00
(1.200)	Virtus Investment Partners Inc	Morgan Stanley	0	0,00
138.318	Visa Inc Class A	Morgan Stanley	3.486	0,00
3.127.504	Vishay Intertechnology Inc	Nomura	0	0,00
8.500.000	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	214.957	0,01
(41.900)	Vista Outdoor Inc	Morgan Stanley	0	0,00
26.612	Visteon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.400)	Vistra Corp	Morgan Stanley	0	0,00
29.107	Vistry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.520	0,00
57.700	Vizio Holding Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
474.612	VMware Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	4.497	0,00
12.003	VMware Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
3.707.581	Vodacom Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	16.822	0,00
11.656.595	Vodacom Group Ltd	Goldman Sachs International	69.086	0,00
(517)	Vodafone Group Plc	JPMorgan Chase Bank	55.478	0,00
(8.961)	Vodafone Group Plc	Morgan Stanley	21.594	0,00
230.307	Volkswagen AG	Goldman Sachs International	39.072	0,00
1.025.248	Volkswagen AG	Morgan Stanley	191.759	0,01
(7.590.429)	Volvo AB	JPMorgan Chase Bank	92.342	0,00
(3.104.569)	Volvo AB Class B	Goldman Sachs International	26.065	0,00
(12.233.512)	Volvo AB Class B	Morgan Stanley	231.642	0,01
(25.800)	Vontier Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.265.890	Vornado Realty Trust	Goldman Sachs International	43.514	0,00
(7.200)	Vornado Realty Trust	Morgan Stanley	0	0,00
3.700	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(606.123)	Vulcan Materials Co	JPMorgan Chase Bank	83.004	0,00
(5.384.558)	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs International	108.786	0,01
(115.272)	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	7.685	0,00
(905.000)	Vy Global Growth Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
78.200	W&T Offshore Inc	Morgan Stanley	0	0,00
26.100	Wabash National Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(868.487)	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs International	6.589	0,00
(4.700)	Walker & Dunlop Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.535.695)	Walmart Inc	Goldman Sachs International	37.211	0,00
(29.800)	Walmart Inc	Morgan Stanley	0	0,00
24.583	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	709	0,00
(51.899)	Walt Disney Co	Morgan Stanley	2.232	0,00
502.078	Walt Disney Co	JPMorgan Chase Bank	19.948	0,00
(23.500)	Warby Parker Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
577.951	Warner Bros Discovery Inc	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
22.300	Warner Music Group Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
7.700	Warrior Met Coal Inc	Morgan Stanley	0	0,00
682.472	Wartsila OYJ Abp	JPMorgan Chase Bank	92.715	0,00
(11.700)	Washington Federal Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(20.000)	Waste Management Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.299.886)	Waters Corp	Goldman Sachs International	307.394	0,01
(356.989)	Waters Corp	JPMorgan Chase Bank	19.090	0,00
600	Waters Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(11.250)	Watsco Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.100	Watts Water Technologies Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
129.264	Wayfair Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	27.471	0,00
4.593.691	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.388.609	Wayfair Inc Class A	Morgan Stanley	190.352	0,01
(5.200)	WD-40 Co	Morgan Stanley	0	0,00
(911.588)	Weatherford International Plc	Morgan Stanley	154.288	0,01
(767.325)	Weatherford International Plc	JPMorgan Chase Bank	149.456	0,01
(413.144)	Weatherford International Plc	Goldman Sachs International	63.143	0,00
500	Weathernews Inc	Bank of America Merrill Lynch	515	0,00
19.437	Webster Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.900	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.600)	Weis Markets Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.100	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.150	0,00
189.121	Welltower Inc	JPMorgan Chase Bank	5.219	0,00
(118.433)	Welltower Inc	Goldman Sachs International	43.652	0,00
(71.500)	Welltower Inc	Morgan Stanley	0	0,00
48.200	Wendy's Co	Morgan Stanley	0	0,00
6.800	Werner Enterprises Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.400	WesBanco Inc	Morgan Stanley	0	0,00
26.018	WESCO International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.400)	West Pharmaceutical Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(448.183)	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs International	6.456	0,00
(5.500)	Westamerica BanCorp	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
503.965	Western Digital Corp	JPMorgan Chase Bank	47.243	0,00
36.400	Western Digital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
164.206	Western Midstream Partners LP	Goldman Sachs International	6.702	0,00
14.400	Western Midstream Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
22.100	Western Union Co	Morgan Stanley	0	0,00
290.205	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	Westlake Corp	Morgan Stanley	0	0,00
13.200	Westrock Co	Morgan Stanley	0	0,00



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(7.300)	WEX Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(56.800)	Weyerhaeuser Co	Morgan Stanley	0	0,00
13.384	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(11.919)	Whitbread Plc	Bank of America Merrill Lynch	10.049	0,00
(446.053)	Whitbread Plc	Goldman Sachs International	15.050	0,00
61.800	Wide Open West Inc	Morgan Stanley	0	0,00
224.098	Williams Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(22.000)	Williams Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.089.599	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	463.725	0,02
2.666.948	Williams-Sonoma Inc	JPMorgan Chase Bank	85.521	0,00
375.027	Williams-Sonoma Inc	Goldman Sachs International	11.395	0,00
2.100	Wills Towers Watson Plc	Morgan Stanley	0	0,00
38.000	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
979.812	Wingstop Inc	Morgan Stanley	93.265	0,00
21.611	Winnebago Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
430.056	Winnebago Industries Inc	Morgan Stanley	38.283	0,00
15.400	Wintrust Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.139)	Wise Plc Class A	Bank of America Merrill Lynch	631	0,00
8.800	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(283.923)	Wizz Air Holdings Plc	Goldman Sachs International	66.385	0,00
256.565	Wolfspeed Inc	Goldman Sachs International	52.717	0,00
296.086	Wolfspeed Inc	Morgan Stanley	52.925	0,00
375.264	Wolfspeed Inc	JPMorgan Chase Bank	66.499	0,00
404.644	Wolters Kluwer NV	Morgan Stanley	22.656	0,00
35.111	Wolters Kluwer NV	JPMorgan Chase Bank	713	0,00
171.088	Wolters Kluwer NV	Goldman Sachs International	1.278	0,00
1.000	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(36.261)	Woodward Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(499.578)	Workday Inc Class A	Morgan Stanley	42.461	0,00
(146.111)	Workday Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	13.566	0,00
6.200	Workiva Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(300)	Workman Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	105	0,00
7.337	Workspace Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	9.188	0,00
(6.400)	World Fuel Services Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.900	World Wrestling Entertainment Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
19.100	Worthington Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(23.000)	WP Carey Inc	Morgan Stanley	0	0,00
18.792	WPP Plc	Morgan Stanley	1.389	0,00
(3.500)	WR Berkley Corp	Morgan Stanley	0	0,00
69.855.460	W-Scope Corp	Goldman Sachs International	105.334	0,01
4.800	W-Scope Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.379	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
71.330.726	W-Scope Corp	Morgan Stanley	131.589	0,01
(2.820)	WSFS Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(200)	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.226.154	WW Grainger Inc	JPMorgan Chase Bank	116.759	0,01
(1.457.237)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	678	0,00
(600.139)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	67.457	0,00
(2.087.506)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
12.400	Xcel Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
78.100	Xenia Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(398.249)	Xenon Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	202.027	0,01
(81.882)	Xenon Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	5.239	0,00
85.500	Xerox Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(23.500)	Xometry Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(87.000)	XP Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(10.000)	XPEL Inc	Morgan Stanley	0	0,00
286.905	XPeng Inc	Goldman Sachs International	22.380	0,00
711.879	XPeng Inc	Morgan Stanley	18.171	0,00
(6.120)	Xperi Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(29.000)	XPO Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.208	XPO Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.800	Xylem Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	Yakult Honsha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	922	0,00
39.600	Yamada Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.289	0,00
28.600	Yamaguchi Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	25.304	0,00
1.800	Yamaha Corp	Bank of America Merrill Lynch	328	0,00
(5.000)	Yamaha Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	830	0,00
12.600	YA-MAN Ltd	Bank of America Merrill Lynch	35.095	0,00
500	Yamato Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	538	0,00
3.800	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.447	0,00
500	Yaoko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20	0,00
570.385.060	Yaoko Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(3.600)	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.687	0,00
7.367.655	Yeahka Ltd	Nomura	0	0,00
(7.404)	Yellow Cake Plc	Bank of America Merrill Lynch	109	0,00
74.800	Yelp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.000)	YETI Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	Yokohama Rubber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	539	0,00
6.400	Yonex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.048	0,00
2.744.718	Yum China Holdings Inc	Morgan Stanley	43.315	0,00
3.200	Yum! Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(20.014)	Zalando SE	Morgan Stanley	0	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 2,49 % (31. Dezember 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(5.000)	Zebra Technologies Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
331.778	Zentalis Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	51.894	0,00
103.980	Zentalis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	30.483	0,00
26.100	Zeta Global Holdings Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(6.900)	Ziff Davis Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.600	Zillow Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
21.500	Zillow Group Inc Class C	Morgan Stanley	0	0,00
(63.800)	ZIM Integrated Shipping Services Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(1.027.112)	Zimmer Biomet Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	35.235	0,00
(2.988.959)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs International	226.039	0,01
(2.118.775)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Morgan Stanley	31.611	0,00
28.600	Zions Bancorp NA	Morgan Stanley	0	0,00
11.900	ZipRecruiter Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
31.500	Zoetis Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.132.819)	Zoetis Inc	Goldman Sachs International	28.670	0,00
24.800	Zoom Video Communications Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
200	ZoomInfo Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.343.439	ZTO Express Cayman Inc	Nomura	0	0,00
(17.000)	Zuora Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
478.630	Zur Rose Group AG	Société Générale	0	0,00
(51.300)	Zurn Water Solutions Corp Class C	Morgan Stanley	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b>			<b>78.118.012</b>	<b>2,49</b>

### Gekaufte Swaptions 0,04 % (31. Dezember 2021: 0,01 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Beschreibung	Gegenpartei	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Call Swaptions</b>					
480.000.000 EUR	18.01.2023	EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 480,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S38, strike 1.05%	JPMorgan Chase Bank	275.391	0,01
102.000.000 USD	15.03.2023	USD 10 Year Interest Rate, strike 2.3% Swaption	Morgan Stanley	67.404	0,00
102.000.000 USD	15.03.2023	USD 10 Year Interest Rate, strike 3.2% Swaption	Morgan Stanley	983.397	0,03
<b>Put-Swaptions</b>					
200.000.000 USD	03.07.2023	Constant Maturity Swap on spread between 10-year and 2-year USD Constant Maturity Swap rates, strike 0.50%	Goldman Sachs International	62.200	0,00
<b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: 4.324.623 US\$)</b>				<b>1.388.392</b>	<b>0,04</b>

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,05 % (31. Dezember 2021: 0,01 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
17.700.000 USD	20.06.2025	Goldman Sachs International	Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025	1.358.885	0,05
1.000.000 USD	20.06.2025	Goldman Sachs International	Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025	76.773	0,00
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b>				<b>1.435.658</b>	<b>0,05</b>

### Zinsswap-Kontrakte 2,10 % (31. Dezember 2021: 0,38 %)

Nominalwert	Fällig- keit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlu- ng)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens	
EUR	348.000.000	20.12.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	(0,18 %)	12M EURIBOR	11.487.235	0,37
EUR	347.900.000	20.12.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	(0,15 %)	1D EURIBOR	11.375.419	0,36
BRL	902.105.587	02.01.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	8,88 %	1D BROIS	5.333.600	0,17
EUR	149.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	(0,18 %)	1D EURIBOR	4.852.862	0,16
EUR	149.100.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	(0,15 %)	1D EURIBOR	4.811.113	0,15
EUR	2.010.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	3,31 %	1D EURIBOR	3.555.645	0,11
BRL	326.209.854	03.07.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	10,16 %	1D BROIS	2.208.734	0,07
MXN	1.164.400.000	08.02.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,60 %	28D MXIBTIIE	2.021.331	0,06
JPY	10.543.200.000	21.12.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	0,64 %	12M JPY LIBOR	1.747.763	0,06
JPY	10.557.000.000	21.12.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	0,64 %	12M JPY LIBOR	1.742.358	0,06
JPY	10.626.000.000	21.12.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	0,67 %	12M JPY LIBOR	1.544.712	0,05
EUR	1.688.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	3,37 %	1D EURIBOR	1.496.521	0,05
MXN	777.450.000	08.02.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	7,60 %	28D MXIBTIIE	1.351.703	0,04
EUR	1.688.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	3,45 %	1D EURIBOR	1.146.864	0,04
PLN	568.000.000	17.04.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	3,96 %	1D WIBOR	963.887	0,03
JPY	30.872.000.000	15.03.2026	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	0,29 %	12M JPY LIBOR	927.639	0,03
JPY	30.600.000.000	15.03.2026	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	0,30 %	12M JPY LIBOR	860.666	0,03
MXN	784.800.000	10.05.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	8,93 %	28D MXIBTIIE	826.973	0,03
EUR	1.500.000.000	15.03.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	2,26 %	1D EURIBOR	747.673	0,02
EUR	1.600.000.000	18.04.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	2,48 %	1D EURIBOR	743.216	0,02
MXN	2.216.800.000	05.12.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,64 %	28D MXIBTIIE	563.641	0,02
BRL	197.240.881	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	13,48 %	1D BROIS	555.509	0,02
MXN	1.468.800.000	13.06.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,44 %	28D MXIBTIIE	532.831	0,02
MXN	1.482.400.000	06.12.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,55 %	28D MXIBTIIE	494.567	0,02
JPY	15.436.000.000	15.03.2026	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	0,29 %	12M JPY LIBOR	460.330	0,02
CLP	33.840.000.000	30.05.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	6,29 %	1D CLICP	405.110	0,01
BRL	377.622.294	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	12,98 %	1D BROIS	393.549	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 2,10 % (31. Dezember 2021: 0,38 %) (Fortsetzung)

Nominalwert	Fällig- keit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlu- ng) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
BRL 391.172.580	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	14,02 %	1D BROIS	387.344	0,01
BRL 260.711.533	01.07.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	13,58 %	1D BROIS	360.372	0,01
EUR 3.576.000.000	22.03.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	2,36 %	1D EURIBOR	243.110	0,01
BRL 369.959.970	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	13,82 %	1D BROIS	239.693	0,01
BRL 699.092.540	03.07.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	13,95 %	1D BROIS	188.433	0,01
BRL 125.325.826	01.07.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	13,95 %	1D BROIS	178.703	0,01
MXN 441.600.000	06.09.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,99 %	28D MXIBTIIE	162.025	0,01
EUR 1.728.000.000	22.03.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	2,35 %	1D EURIBOR	138.592	0,00
GBP 5.829.500.000	02.02.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	3,43 %	1D SONIA	132.322	0,00
PLN 114.480.000	20.05.2027	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,35 %	6M WIBOR	93.239	0,00
BRL 94.477.677	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	12,92 %	1D BROIS	71.198	0,00
MXN 2.740.400.000	29.11.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,02 %	28D MXIBTIIE	45.505	0,00
PLN 64.800.000	20.05.2032	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,12 %	6M WIBOR	45.216	0,00
MXN 2.883.200.000	27.11.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,93 %	28D MXIBTIIE	42.431	0,00
CNY 1.237.600.000	05.12.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,21 %	3M CFXS	37.794	0,00
CNY 1.224.000.000	05.12.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,21 %	3M CFXS	33.357	0,00
MXN 2.155.600.000	27.11.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	9,93 %	28D MXIBTIIE	31.723	0,00
MXN 1.666.000.000	30.11.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,02 %	28D MXIBTIIE	28.956	0,00
MXN 1.122.000.000	30.11.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,04 %	28D MXIBTIIE	27.083	0,00
MXN 2.046.800.000	29.11.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	11,01 %	28D MXIBTIIE	24.793	0,00
CZK 460.800.000	27.06.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,84 %	6M PRIBOR	11.259	0,00
BRL 359.523.766	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	13,48 %	1D BROIS	3.836	0,00
PLN 100.000	15.12.2026	Intercontinental Exchange <sup>1</sup>	Erhalt	1,44 %	6M WIBOR	3.727	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>65.682.162</b>	<b>2,10</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Inflation- Swap-Kontrakte 0,87 % (31 Dezember 2021: 0,00 %)

Nominalwert	Fällig- keit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens	
EUR	95.850.000	15.01.2025	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	2,26 %	CPTFEMU	9.778.309	0,31
EUR	95.850.000	15.01.2025	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	2,26 %	CPTFEMU	9.778.308	0,31
EUR	74.550.000	15.01.2025	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	2,26 %	CPTFEMU	7.604.185	0,25
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten</b> <sup>∞</sup>						<b>27.160.802</b>	<b>0,87</b>	

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Total Return Swap-Kontrakte 0,12 % (31. Dezember 2021: 0,17 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
29.978.443 USD	17.03.2023	0,00 <sup>1</sup>	Société Générale Basket SGBVRRU <sup>2</sup>	2.477.772	0,09
16.802.795 USD	22.01.2024	1,12 <sup>3</sup>	JPMorgan Basket JPABKXS <sup>4</sup>	383.556	0,01
(5.229.115) USD	22.12.2023	1,36 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBQQQ <sup>6</sup>	152.835	0,01
1.982.443 USD	19.01.2023	0,15 <sup>7</sup>	Société Générale Basket SGEPBSH <sup>2</sup>	118.883	0,01
(2.820.801) USD	06.11.2024	4,11 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBQQQ <sup>6</sup>	88.236	0,00
(2.008.350) USD	06.11.2024	4,03 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLE <sup>6</sup>	77.156	0,00
(4.240.715) USD	06.11.2024	4,11 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>6</sup>	71.189	0,00
(903.422) USD	22.12.2023	1,24 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSMH <sup>6</sup>	63.501	0,00
2.044.530 USD	06.11.2024	4,76 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUIH <sup>6</sup>	59.563	0,00
(2.725.352) EUR	06.11.2024	4,11 <sup>8</sup>	Morgan Stanley Basket MSABELC <sup>2</sup>	41.330	0,00
2.969.024 USD	06.11.2024	4,76 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLU <sup>6</sup>	37.505	0,00
(639.592) USD	06.11.2024	4,76 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUTAN <sup>6</sup>	36.472	0,00
(681.479) USD	17.07.2025	1,51 <sup>1</sup>	Goldman Sachs Basket GSXUEDEF <sup>9</sup>	34.077	0,00
(384.355) USD	06.11.2024	1,36 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSOX <sup>6</sup>	28.046	0,00
(1.522.118) USD	06.11.2024	4,02 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT <sup>6</sup>	23.859	0,00
(1.089.168) USD	06.11.2024	4,03 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLC <sup>6</sup>	23.087	0,00
(617.160) EUR	06.11.2023	1,61 <sup>10</sup>	JPMorgan Basket JPAYMCPH <sup>4</sup>	23.041	0,00
(1.167.965) USD	22.12.2023	0,93 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MS15TAN <sup>6</sup>	21.049	0,00
(3.051.966) USD	06.11.2024	4,08 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXOP <sup>6</sup>	20.988	0,00
(902.910) USD	06.11.2024	4,11 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBQQQ <sup>6</sup>	19.123	0,00
(2.619.723) USD	06.11.2024	4,11 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>6</sup>	19.031	0,00
(1.040.034) USD	09.01.2023	1,17 <sup>3</sup>	JPMorgan Basket JP1STP <sup>4</sup>	18.275	0,00
5.893.852 USD	01.08.2023	4,30 <sup>1</sup>	S&P 500 TR Index <sup>9</sup>	13.717	0,00
684.588 USD	17.04.2024	0,78 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSACRET <sup>6</sup>	13.646	0,00
(617.916) USD	25.09.2023	1,36 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>6</sup>	13.638	0,00
(1.143.316) USD	25.09.2023	1,28 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLY <sup>6</sup>	6.730	0,00
(463.470) USD	22.12.2023	1,31 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI <sup>6</sup>	2.632	0,00
(74.162) USD	06.11.2024	4,03 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUIWF <sup>6</sup>	2.497	0,00

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Total Return Swap-Kontrakte 0,12 % (31. Dezember 2021: 0,17 %) (Fortsetzung)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1.278.505) USD	06.11.2024	4,08 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLV <sup>6</sup>	2.179	0,00
(1.223.683) USD	06.11.2024	4,03 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLY <sup>6</sup>	2.067	0,00
(860.589) USD	21.07.2023	1,33 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLV <sup>6</sup>	1.691	0,00
(21.593) USD	06.11.2024	4,08 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUMGK <sup>6</sup>	1.108	0,00
125.628 USD	25.09.2023	1,36 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>6</sup>	536	0,00
(37.914) USD	27.11.2024	3,88 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUVG1 <sup>6</sup>	293	0,00
(7.693) USD	06.11.2024	4,11 <sup>5</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>6</sup>	141	0,00
6.056.461 USD	19.04.2023	0,00 <sup>7</sup>	Goldman Sachs Basket GSVICQ1E <sup>9</sup>	0	0,00
2.278.030 USD	19.04.2023	0,00 <sup>7</sup>	Goldman Sachs Basket GSVILG10 <sup>9</sup>	0	0,00
9.255.378 USD	19.04.2023	0,00 <sup>7</sup>	Goldman Sachs Basket GSVIRVU2 <sup>9</sup>	0	0,00
(13.837.377) EUR	06.10.2023	1,91 <sup>10</sup>	STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services Index <sup>9</sup>	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>3.899.449</b>	<b>0,12</b>

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Société Générale.

<sup>3</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-OBFR.

<sup>4</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

<sup>6</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

<sup>7</sup> Fester Zinssatz.

<sup>8</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Monats-EURIBOR.

<sup>9</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>10</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-ESTR.

### Correlation-Swap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2021: 0,01 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation	Korrelation zum Ausübungszeitpunkt in Prozent	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
70.000 USD	20.01.2023	BNP	Basket of US Banks correlation swap 21/08/2027	86,25 %	439.031	0,01
4.200.000 USD	20.01.2023	BNP	Basket of US Banks correlation swap 21/09/2023	86,65 %	261.913	0,01
4.000.000 USD	14.06.2023	BNP	USD FX correlation swap EUR/BRL vs USD/BRL	90,30 %	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>700.944</b>	<b>0,02</b>

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2021: 0,08 %)

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation	Volatilität-Ausübungssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
500.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 45 Names US Basket	Various	435.133	0,01
200.000 USD	15.12.2023	BNP	Euro STOXX Banks vs S&P 500 Index	6,50 %/10,50 %	381.900	0,01

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2021: 0,08 %) (Fortsetzung)

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Volatilität- Ausübungssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover- mögens
900.000 USD	20.11.2024	Goldman Sachs International	GS 128 Pairwise Theta Flat CoVol	Various	129.210	0,01
240.000 USD	20.12.2024	Goldman Sachs International	Euro STOXX 50 Index vs S&P 500 Index	Various	25.307	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Variance-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>971.550</b>	<b>0,03</b>

### Inflation-Swap-Kontrakte 1,03 % (31. Dezember 2021: 0,17 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation <sup>1</sup>	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover- mögens
110.000.000 EUR	20.06.2024	BNP	BNP 20 Names Slider European Basket	3.022.282	0,09
100.000.000 EUR	21.06.2024	BNP	BNP 30 Names Slider European Basket	2.734.608	0,09
75.000.000 EUR	21.06.2024	BNP	BNP 19 Names EU and US Slider Basket	1.916.185	0,06
75.000.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP 8 Names EU Down Geo Basket	1.700.325	0,05
37.500.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 12 Names US Geo Basket	1.531.869	0,05
30.000.000 USD	20.01.2023	BNP	BNP 24 Names Global Basket	1.491.717	0,05
30.000.000 USD	20.01.2023	UBS	UBS 32 Names US Basket	1.232.371	0,04
40.000.000 USD	20.01.2023	BNP	BNP 25 Names US Basket	1.162.343	0,04
50.010.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 45 Names US Basket	1.138.550	0,04
50.000.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP 4 Names EU Down Geo Basket	1.089.932	0,04
35.000.000 EUR	16.06.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 19 Names EU Basket	1.006.422	0,03
35.000.000 EUR	16.06.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 20 Names EU Basket	994.087	0,03
25.000.000 USD	20.01.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 23 Names US Basket	983.306	0,03
25.000.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP 30 Names Slider European Basket	931.679	0,03
100.000.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP EU Down Geo Basket	917.339	0,03
50.000.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP 20 Names EU Basket	894.202	0,03
50.000.000 EUR <sup>2</sup>	15.12.2023	BNP	BNP 10 Names Global Geo Basket	886.226	0,03
30.000.000 EUR <sup>2</sup>	20.01.2023	BNP	BNP 24 Names Global Basket	879.447	0,03
156.000.000 HKD	30.03.2023	BNP	BNP 19 Names Kong Kong IFUSH Basket	741.380	0,02
30.000.000 EUR	16.06.2023	Citibank NA	CITI 17 Names EU Basket	679.655	0,02
3.500.000 EUR	15.12.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 14 Names EU Basket	664.002	0,02
50.000.000 USD	20.01.2023	BNP	BNP 32 Names Global Basket	638.275	0,02
35.000.000 USD	20.01.2023	BNP	BNP 20 Names US Basket	627.470	0,02
30.000.000 EUR	16.06.2023	BNP	BNP 25 Names EU Basket	583.275	0,02
35.000.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP 20 Names Slider European Basket	539.891	0,02
40.000.000 EUR	16.06.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 18 Names EU Basket	520.157	0,02
85.000.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP 8 Names EU Down Geo Basket	423.377	0,01
30.000.000 USD	20.01.2023	BNP	BNP 24 Names Global Basket	403.274	0,01
35.000.000 EUR	15.12.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 18 Names EU Basket	360.461	0,01



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Volatility-Swap-Kontrakte 1,03 % (31. Dezember 2021: 0,17 %) (Fortsetzung)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation <sup>1</sup>	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
70.000.000 EUR <sup>2</sup>	15.12.2023	BNP	Euro STOXX 50 Index & FTSE 100 Index Geo Q Basket	265.787	0,01
28.000.000 EUR	16.06.2023	UBS	UBS 7 Names Euro Bank Basket	222.471	0,01
45.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 12 Names EU Down Geo Basket	206.266	0,01
35.000.000 EUR	15.12.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 14 Names EU Basket	195.042	0,01
50.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 10 Names EU Down Geo Basket	133.317	0,01
40.000.000 EUR	15.12.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 15 Names EU Basket	128.008	0,00
2.870.000.000 JPY	15.12.2023	BNP	BNP 29 Names Japan Corridor Basket	55.639	0,00
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	35.651	0,00
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	35.651	0,00
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	35.651	0,00
250.003 USD	20.12.2024	BNP	BNP Down Pairwise US Basket	28.943	0,00
20.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 15 Names EU Basket	25.899	0,00
20.000.000 USD	19.01.2024	Bank of America Merrill Lynch	BAML 17 Names US Basket	23.592	0,00
62.500 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	17.826	0,00
62.500 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	17.826	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>2</sup></b>				<b>32.121.676</b>	<b>1,03</b>

<sup>1</sup>Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

<sup>2</sup> Bei Volatilität gehandelter Dispersion-Swap.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>2.555.941.719</b>	<b>81,65</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
2.280.000 AUD	1.552.097 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	2	(1.432)	(0,00)
290.000 AUD	198.623 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	(1.389)	(0,00)
300.000 AUD	27.685.860 ¥	15.03.2023	Citibank NA	1	(7.795)	(0,00)
590.000 AUD	406.178 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	(4.910)	(0,00)
1.480.000 AUD	134.164.134 ¥	15.03.2023	Deutsche Bank AG	3	(19.944)	(0,00)
1.106.898 AUD	625.000 £	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.004)	(0,00)
8.004.766 AUD	5.125.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(43.645)	(0,00)
400.000 AUD	367.900 CAD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(107)	(0,00)
43.200.000 AUD	29.569.194 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(254.147)	(0,01)
50.200.000 AUD	4.600.429.472 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	9	(873.556)	(0,03)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
170.000 AUD	117.186 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(1.566)	(0,00)
2.360.000 AUD	1.608.826 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	2	(3.752)	(0,00)
320.000 AUD	29.528.384 ¥	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	(8.290)	(0,00)
940.000 AUD	645.070 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	4	(5.760)	(0,00)
1.260.000 AUD	114.088.877 ¥	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	6	(15.968)	(0,00)
130.000 AUD	89.576 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	(1.160)	(0,00)
630.000 AUD	58.142.300 ¥	15.03.2023	UBS AG	2	(16.384)	(0,00)
14.030.000 BRL	2.671.910 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	9	(49.210)	(0,00)
3.460.000 BRL	660.014 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	(13.219)	(0,00)
11.000.000 BRL	2.086.315 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	3	(30.028)	(0,00)
22.499.394 BRL	4.300.000 US\$	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	28	(38.551)	(0,00)
3.157.971 BRL	600.000 US\$	02.02.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(5.433)	(0,00)
5.030.000 CAD	3.722.557 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	4	(8.165)	(0,00)
770.000 CAD	569.614 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	(1.009)	(0,00)
40.600.000 CAD	29.997.921 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(31.481)	(0,00)
6.800.000 CAD	674.346.312 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	(102.425)	(0,01)
4.017.536 CAD	4.400.000 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(20.489)	(0,00)
6.122.122 CAD	4.250.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	(22.060)	(0,00)
3.580.000 CAD	2.651.437 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(7.795)	(0,00)
2.850.000 CAD	2.110.561 US\$	15.03.2023	UBS AG	4	(5.984)	(0,00)
90.000 CHF	98.487 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	(460)	(0,00)
330.000 CHF	360.260 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	(829)	(0,00)
4.552.860 CHF	4.625.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	8	(12.003)	(0,00)
25.500.000 CHF	27.642.949 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(34.072)	(0,00)
790.000 CHF	862.076 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	5	(1.619)	(0,00)
2.410.318.125 COP	500.000 US\$	12.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(3.708)	(0,00)
2.412.028.125 COP	500.000 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(3.826)	(0,00)
478.070.625 COP	100.000 US\$	27.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.843)	(0,00)
474.758.625 COP	100.000 US\$	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(2.578)	(0,00)
3.352.062.019 COP	700.000 US\$	23.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	(11.236)	(0,00)
480.489.625 COP	100.000 US\$	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.215)	(0,00)
6.217.453.125 COP	1.300.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(21.503)	(0,00)
1.930.859.787 COP	400.000 US\$	10.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(2.274)	(0,00)
1.945.595.569 COP	403.374 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(2.129)	(0,00)
960.147.250 COP	200.000 US\$	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(2.026)	(0,00)
2.259.644 CZK	100.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(250)	(0,00)
200.000 CZK	8.810 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	(7)	(0,00)
162.720.000 EGP	7.074.783 US\$	02.05.2023	Morgan Stanley	1	(1.234.011)	(0,04)
4.128.245 €	19.660.000 PLN	15.03.2023	Citibank NA	4	(28.099)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
110.000 €	118.454 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	(488)	(0,00)
2.875.000 €	4.175.870 CAD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(10.493)	(0,00)
4.125.000 €	6.562.590 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(46.119)	(0,00)
1.500.000 €	1.483.460 CHF	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(3.531)	(0,00)
800.000 €	3.777.808 PLN	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	(5.505)	(0,00)
130.000 €	139.456 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(42)	(0,00)
600.000 €	249.600.882 HUF	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(20.960)	(0,00)
750.000 €	7.908.109 NOK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(1.987)	(0,00)
166.800.000 €	24.073.158.508 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(4.617.141)	(0,16)
622.520 €	2.960.000 PLN	15.03.2023	Morgan Stanley	4	(3.188)	(0,00)
730.000 €	783.303 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(440)	(0,00)
177.271 €	840.000 PLN	15.03.2023	UBS AG	1	(250)	(0,00)
250.000 €	268.161 US\$	15.03.2023	UBS AG	2	(57)	(0,00)
2.830.000 £	3.484.956 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	9	(74.698)	(0,00)
31.500.000 £	5.191.125.723 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(1.517.360)	(0,04)
29.312.500 £	35.779.566 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	9	(504.526)	(0,01)
144.076.108 £	165.900.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	11	(3.865.848)	(0,12)
5.750.000 £	6.519.600 CHF	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	9	(139.153)	(0,00)
9.750.000 £	17.621.751 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	8	(224.653)	(0,00)
310.000 £	380.047 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	4	(6.486)	(0,00)
42.000.000 HKD	5.396.975 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(8.612)	(0,00)
37.697.860 HUF	100.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(16)	(0,00)
7.960.000 ILS	2.340.329 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	(75.589)	(0,00)
3.760.000 ILS	1.110.542 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(40.765)	(0,00)
3.850.000 ILS	1.136.809 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	2	(41.426)	(0,00)
8.980.000 ILS	2.649.840 US\$	15.03.2023	UBS AG	5	(94.895)	(0,00)
47.550.000 INR	571.862 US\$	15.03.2023	Citibank NA	4	(197)	(0,00)
32.945.486 INR	400.000 US\$	13.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(2.072)	(0,00)
16.539.943 INR	200.000 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(285)	(0,00)
8.262.164 INR	100.000 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(131)	(0,00)
16.550.243 INR	200.000 US\$	23.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(251)	(0,00)
8.125.371 INR	100.000 US\$	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.793)	(0,00)
8.202.671 INR	100.000 US\$	09.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(893)	(0,00)
8.256.771 INR	100.000 US\$	12.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(264)	(0,00)
15.680.000 INR	188.564 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Canada	1	(53)	(0,00)
56.263.419 ¥	640.000 AUD	15.03.2023	Deutsche Bank AG	4	(4.791)	(0,00)
58.700.000 ¥	449.971 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	4	(846)	(0,00)
1.074.422.040 ¥	13.000.000 NZD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(63.828)	(0,00)
35.246.383 ¥	400.000 AUD	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(2.369)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
5.050.881.383 ¥	36.100.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(209.773)	(0,01)
5.000.000.000 ¥	38.113.464 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(140.135)	(0,01)
25.350.000 ¥	194.282 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(324)	(0,00)
33.482.589 ¥	380.000 AUD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(2.262)	(0,00)
31.744.846 ¥	360.000 AUD	15.03.2023	UBS AG	3	(1.957)	(0,00)
9.230.000 MXN	471.852 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	1	(4.251)	(0,00)
7.100.000 MXN	360.852 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	(1.159)	(0,00)
6.850.000 MXN	348.230 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(1.202)	(0,00)
10.140.000 NOK	1.042.466 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	6	(9.998)	(0,00)
14.382.408 NOK	1.375.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(8.117)	(0,00)
2.500.000 NOK	2.644.805 SEK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(120)	(0,00)
18.509.964 NOK	1.900.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(19.785)	(0,00)
7.800.000 NOK	799.855 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	4	(5.650)	(0,00)
26.930.000 NOK	2.764.859 US\$	15.03.2023	UBS AG	11	(22.813)	(0,00)
290.000 NZD	184.032 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	(472)	(0,00)
430.000 NZD	273.648 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(1.473)	(0,00)
1.915.207 NZD	1.800.000 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(9.915)	(0,00)
24.400.000 NZD	2.109.576.368 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(586.266)	(0,02)
10.300.000 NZD	6.591.271 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(75.566)	(0,00)
2.195.000 NZD	1.405.237 US\$	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	(15.878)	(0,00)
1.230.000 NZD	788.408 US\$	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	6	(9.861)	(0,00)
2.505.000 NZD	1.603.142 US\$	15.03.2023	UBS AG	3	(17.564)	(0,00)
28.150.000 PHP	506.872 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	3	(2.550)	(0,00)
13.250.000 PHP	239.787 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	(2.407)	(0,00)
880.000 PLN	199.959 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	(536)	(0,00)
1.875.644 PLN	400.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(267)	(0,00)
438.556 PLN	100.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(138)	(0,00)
1.170.000 PLN	247.384 €	15.03.2023	UBS AG	2	(157)	(0,00)
850.000 PLN	192.702 US\$	15.03.2023	UBS AG	1	(77)	(0,00)
18.352.727 SEK	1.800.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(36.994)	(0,00)
17.925.651 SEK	1.625.000 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	(14.183)	(0,00)
3.135.219 SEK	3.000.000 NOK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(3.560)	(0,00)
8.870.000 SEK	868.555 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	2	(13.813)	(0,00)
3.500.000 SEK	341.223 US\$	15.03.2023	UBS AG	3	(3.951)	(0,00)
12.150.000 THB	355.197 US\$	15.03.2023	BNP Paribas	3	(1.982)	(0,00)
12.500.000 THB	364.103 US\$	15.03.2023	Citibank NA	2	(713)	(0,00)
50.220.000 THB	1.461.147 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	(1.192)	(0,00)
298.686.483 TRY	15.500.000 US\$	15.02.2023	JPMorgan Chase Bank	8	(64.021)	(0,00)
2.330.000 TRY	118.816 US\$	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(776)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
13.324.397 TRY	630.000 €	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(596)	(0,00)
125.020.000 TRY	6.382.943 US\$	15.03.2023	UBS AG	3	(49.326)	(0,00)
3.067.817 TWD	100.000 US\$	06.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(164)	(0,00)
12.157.071 TWD	400.000 US\$	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	(3.968)	(0,00)
3.050.168 TWD	100.000 US\$	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(622)	(0,00)
27.507.279 TWD	900.000 US\$	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(3.017)	(0,00)
3.020.048 TWD	100.000 US\$	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.730)	(0,00)
3.062.963 TWD	100.000 US\$	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(344)	(0,00)
170.518 US\$	151.200.000 CLP	15.03.2023	BNP Paribas	1	(5.283)	(0,00)
404.891 US\$	8.100.000 MXN	15.03.2023	BNP Paribas	2	(5.464)	(0,00)
733.934 US\$	7.630.000 SEK	15.03.2023	BNP Paribas	2	(1.319)	(0,00)
2.436.033 US\$	3.300.000 SGD	15.03.2023	BNP Paribas	2	(27.224)	(0,00)
265.703 US\$	360.000 CAD	15.03.2023	BNP Paribas	2	(138)	(0,00)
344.190 US\$	1.870.000 BRL	15.03.2023	BNP Paribas	1	(5.379)	(0,00)
437.754 US\$	36.490.000 INR	15.03.2023	BNP Paribas	2	(942)	(0,00)
2.670.692 US\$	26.480.000 NOK	15.03.2023	BNP Paribas	3	(25.533)	(0,00)
918.637 US\$	18.210.000 MXN	15.03.2023	Citibank NA	2	(3.900)	(0,00)
571.077 US\$	770.000 SGD	15.03.2023	Citibank NA	2	(3.683)	(0,00)
109.190 US\$	1.140.000 SEK	15.03.2023	Citibank NA	1	(664)	(0,00)
1.008.019 US\$	5.430.000 BRL	15.03.2023	Citibank NA	5	(7.040)	(0,00)
287.627 US\$	460.000 NZD	15.03.2023	Citibank NA	1	(3.537)	(0,00)
85.851 US\$	4.810.000 PHP	15.03.2023	Citibank NA	1	(322)	(0,00)
259.899 US\$	240.000 CHF	15.03.2023	Citibank NA	1	(1.506)	(0,00)
1.207.144 US\$	100.450.000 INR	15.03.2023	Citibank NA	4	(504)	(0,00)
3.412.665 US\$	5.080.000 AUD	15.03.2023	Citibank NA	7	(42.325)	(0,00)
255.401 US\$	5.850.000 CZK	15.03.2023	Citibank NA	1	(2.091)	(0,00)
312.020 US\$	272.760.000 CLP	15.03.2023	Citibank NA	2	(5.120)	(0,00)
118.492 US\$	1.170.000 NOK	15.03.2023	Citibank NA	1	(639)	(0,00)
108.296 US\$	90.000 €	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	(157)	(0,00)
74.582 US\$	70.000 €	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	(487)	(0,00)
2.648.104 US\$	3.940.000 AUD	15.03.2023	Deutsche Bank AG	4	(31.554)	(0,00)
77.363 US\$	420.000 BRL	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	(1.149)	(0,00)
2.018.772 US\$	36.010.000 ZAR	15.03.2023	Deutsche Bank AG	3	(84.895)	(0,00)
273.091 US\$	37.010.000 ¥	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	(10.079)	(0,00)
193.646 US\$	1.910.000 NOK	15.03.2023	Deutsche Bank AG	2	(833)	(0,00)
1.019.874 US\$	1.390.000 CAD	15.03.2023	Deutsche Bank AG	8	(6.567)	(0,00)
1.079.098 US\$	1.000.000 CHF	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	(5.172)	(0,00)
56.006.382 US\$	53.250.000 €	09.01.2023	Goldman Sachs International	6	(844.920)	(0,03)
6.105.298 US\$	5.750.000 CHF	09.01.2023	Goldman Sachs International	1	(112.901)	(0,01)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
90.872.025 US\$	12.128.516.493 ¥	15.03.2023	Goldman Sachs International	1	(1.925.540)	(0,06)
19.966.683 US\$	19.100.000 €	31.01.2023	Goldman Sachs International	6	(457.892)	(0,02)
13.381.795 US\$	1.820.000.000 ¥	10.01.2023	Goldman Sachs International	4	(423.081)	(0,02)
4.000.000 US\$	28.004.800 CNY	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	(56.636)	(0,00)
566.605 US\$	900.000 NZD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(2.728)	(0,00)
400.000 US\$	9.300.251 CZK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(10.550)	(0,00)
4.500.000 US\$	3.954.969.791 CLP	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	(136.198)	(0,01)
952 US\$	78.814 INR	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1)	(0,00)
700.000 US\$	947.783 SGD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	4	(6.908)	(0,00)
82.782.182 US\$	112.785.595 CAD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(463.695)	(0,01)
800.000 US\$	3.540.920 PLN	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(6.292)	(0,00)
2.000.000 US\$	19.855.010 NOK	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(16.843)	(0,00)
20.462.074 US\$	201.834.091 NOK	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(88.917)	(0,00)
3.000.000 US\$	1.183.123.060 HUF	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(137.949)	(0,01)
200.000 US\$	6.133.425 TWD	31.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(20)	(0,00)
100.000 US\$	8.282.150 INR	12.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(43)	(0,00)
1.000.000 US\$	17.329.907 ZAR	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	(17.119)	(0,00)
200.000 US\$	259.373.144 KRW	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(5.263)	(0,00)
1.948.860 US\$	1.729.851.413 CLP	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(81.602)	(0,00)
34.000.000 US\$	4.502.545.200 ¥	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(449.822)	(0,02)
200.000 US\$	260.702.644 KRW	06.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(6.460)	(0,00)
20.007.365 US\$	398.680.858 MXN	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(391.152)	(0,01)
336.271 US\$	6.710.000 MXN	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(3.664)	(0,00)
100.000 US\$	3.076.662 TWD	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(101)	(0,00)
300.000 US\$	379.822.117 KRW	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.993)	(0,00)
1.000.000 US\$	82.910.000 INR	23.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(662)	(0,00)
300.000 US\$	384.370.916 KRW	27.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(5.588)	(0,00)
69.476.024 US\$	65.625.001 €	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	(638.254)	(0,03)
200.000 US\$	260.271.145 KRW	25.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(6.914)	(0,00)
1.000.000 US\$	82.977.700 INR	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.706)	(0,00)
600.000 US\$	770.761.566 KRW	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(12.676)	(0,00)
501.636 US\$	11.480.000 CZK	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(3.662)	(0,00)
2.800.000 US\$	14.868.309 BRL	04.01.2023	JPMorgan Chase Bank	21	(16.101)	(0,00)
35.876.262 US\$	33.250.000 CHF	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	9	(123.548)	(0,01)
800.000 US\$	1.043.379.351 KRW	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	6	(29.318)	(0,00)
300.000 US\$	389.791.617 KRW	09.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(9.341)	(0,00)
1.019.467 US\$	1.323.150.391 KRW	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(26.915)	(0,00)
500.000 US\$	2.436.631.875 COP	12.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(1.710)	(0,00)
65.027.536 US\$	96.700.000 AUD	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(592.025)	(0,02)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
400.000 US\$	33.178.440 INR	13.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(742)	(0,00)
100.000 US\$	88.073.517 CLP	05.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(3.368)	(0,00)
2.400.000 US\$	2.108.144.980 CLP	09.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(73.270)	(0,00)
800.000 US\$	701.076.773 CLP	12.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(22.255)	(0,00)
100.000 US\$	87.479.547 CLP	13.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(2.590)	(0,00)
300.000 US\$	268.248.110 CLP	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(14.389)	(0,00)
200.000 US\$	261.647.891 KRW	13.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(7.948)	(0,00)
113.073.650 US\$	15.277.693.665 ¥	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	10	(2.955.331)	(0,10)
100.000 US\$	89.337.297 CLP	20.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(4.693)	(0,00)
100.000 US\$	87.044.197 CLP	27.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.933)	(0,00)
300.000 US\$	263.362.790 CLP	30.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(8.316)	(0,00)
200.000 US\$	171.781.793 CLP	31.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(1.083)	(0,00)
54.900.000 US\$	381.056.033 CNY	19.01.2023	JPMorgan Chase Bank	7	(245.017)	(0,01)
114.024 US\$	3.940.000 THB	15.03.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(516)	(0,00)
400.000 US\$	1.945.595.569 COP	03.01.2023	JPMorgan Chase Bank	3	(1.246)	(0,00)
1.000.000 US\$	890.152.534 CLP	23.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	(42.839)	(0,00)
300.000 US\$	24.889.860 INR	17.01.2023	JPMorgan Chase Bank	1	(538)	(0,00)
21.440.984 US\$	429.462.900 MXN	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(316.036)	(0,01)
7.088.374 US\$	9.200.000.000 KRW	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(234.699)	(0,01)
126.820 US\$	113.260.000 CLP	15.03.2023	Morgan Stanley	2	(4.869)	(0,00)
1.831.358 US\$	2.500.000 CAD	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(14.761)	(0,00)
1.441.753 US\$	10.000.000 CNY	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(12.221)	(0,00)
542.576 US\$	740.000 CAD	15.03.2023	Royal Bank of Canada	5	(3.876)	(0,00)
244.924 US\$	320.540.000 KRW	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	(10.221)	(0,00)
111.149 US\$	9.250.000 INR	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	1	(58)	(0,00)
6.977.132 US\$	9.480.500 CAD	15.03.2023	Royal Bank of Scotland	2	(23.721)	(0,00)
131.908 US\$	180.000 CAD	15.03.2023	Société Générale	1	(1.013)	(0,00)
768.320 US\$	720.000 €	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(3.819)	(0,00)
633.561 US\$	86.030.000 ¥	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(24.670)	(0,00)
5.459.487 US\$	8.110.000 AUD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	15	(56.253)	(0,00)
15.167.775 US\$	20.629.500 CAD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	15	(66.034)	(0,00)
69.338 US\$	110.000 NZD	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(288)	(0,00)
1.031.551 US\$	85.950.000 INR	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	4	(1.770)	(0,00)
259.575 US\$	240.000 CHF	15.03.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(1.830)	(0,00)
41.437.351 US\$	5.517.509.672 ¥	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(778.155)	(0,03)
2.234.305 US\$	39.960.000 ZAR	15.03.2023	UBS AG	3	(100.116)	(0,01)
203.082 US\$	4.020.000 TRY	15.03.2023	UBS AG	1	(574)	(0,00)
211.136 US\$	940.000 PLN	15.03.2023	UBS AG	2	(1.884)	(0,00)
12.706 US\$	290.000 CZK	15.03.2023	UBS AG	1	(58)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2021: (1,59 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
21.695.600 US\$	1.804.640.000 INR	15.03.2023	UBS AG	4	(434)	(0,00)
1.590.000 ZAR	92.915 US\$	15.03.2023	Citibank NA	1	(29)	(0,00)
2.450.000 ZAR	143.489 US\$	15.03.2023	Deutsche Bank AG	1	(363)	(0,00)
2.720.000 ZAR	159.369 US\$	15.03.2023	Morgan Stanley	1	(470)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
50.532 US\$	47.225 CHF	18.01.2023	UBS AG	1	(592)	(0,00)
1.386.918 US\$	1.362.060 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	11	(87.610)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
1.260 €	1.347 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
6.332.675 US\$	6.314.565 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(413.360)	(0,01)
3.494.149 US\$	3.458.371 €	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	(200.530)	(0,01)
55.941.292 US\$	54.207.453 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	54	(1.970.115)	(0,06)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
46.314.036 £	56.237.994 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	32	(504.764)	(0,02)
38.546.903 US\$	33.429.704 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	(1.681.624)	(0,06)
48.969.351 US\$	42.529.766 £	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	3	(2.209.979)	(0,07)
73.704.223 US\$	63.306.419 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	25	(2.477.244)	(0,08)
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
105.898 US\$	15.329.659 ¥	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	1	(10.510)	(0,00)
305.321 US\$	41.927.829 ¥	18.01.2023	UBS AG	1	(13.062)	(0,00)
1.160.250 US\$	166.549.311 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(104.458)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(37.812.332)</b>	<b>(1,21)</b>

### Futures-Kontrakte (0,81 %) (31. Dezember 2021: (1,34 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
113	3 Month SOFR Future December 2023	(19.951)	(0,00)
1.200	3 Month SOFR Future February 2023	(28.403)	(0,00)
800	3 Month SOFR Future January 2023	(13.779)	(0,00)
2.871	3 Month SOFR Future June 2023	(749.557)	(0,03)
(182)	3 Month SOFR Future June 2024	(5.738)	(0,00)
(20)	3 Month SOFR Future June 2025	(2.400)	(0,00)
1.200	3 Month SOFR Future March 2023	(49.493)	(0,00)
112	3 Month SOFR Future March 2024	(24.230)	(0,00)
(23)	3 Month SOFR Future March 2025	(2.200)	(0,00)
(24)	3 Month SOFR Future September 2025	(2.900)	(0,00)



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,81 %) (31. Dezember 2021: (1,34 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(32)	3 Month SOFR Future September 2026	(3.063)	(0,00)
71	3 Month SONIA Future December 2023	(94.779)	(0,00)
(243)	3 Month SONIA Future June 2023	(36.260)	(0,00)
(119)	3 Month SONIA Future June 2024	(65.964)	(0,00)
(425)	3 Month SONIA Future March 2024	(361.818)	(0,01)
239	3 Month SONIA Future September 2023	(35.635)	(0,00)
(73)	3 Month SONIA Future September 2024	(17.547)	(0,00)
(1.572)	30 Day Federal Funds Future January 2023	(46.820)	(0,00)
5.109	30 Day Federal Funds Future February 2023	(185.463)	(0,01)
944	3-Month Euro Euribor Future March 2023	(565.194)	(0,02)
62	90-Day Bank Bill Future December 2023	(36.888)	(0,00)
78	90-Day Bank Bill Future June 2023	(28.716)	(0,00)
414	90-Day Bank Bill Future March 2023	(31.472)	(0,00)
17	Amsterdam Index Future January 2023	(99.873)	(0,00)
(2.631)	Australian Dollar Currency Future March 2023	(1.312.549)	(0,04)
735	Australian Government Bond 10-Year Future March 2023	(2.933.121)	(0,09)
786	Bankers Acceptance Future December 2023	(574.431)	(0,02)
502	Bankers Acceptance Future June 2023	(264.973)	(0,01)
465	Bankers Acceptance Future March 2023	(174.351)	(0,01)
(2)	BIST 30 Index Future February 2023	(155)	(0,00)
29	CAC40 Index Future January 2023	(31.207)	(0,00)
(121)	Canadian Dollar Currency Future March 2023	(71.833)	(0,00)
5	DAX Index Future March 2023	(28.509)	(0,00)
2	DJIA Micro E-mini Future March 2023	(16)	(0,00)
(68)	DJIA Mini E-CBOT Future March 2023	(20.119)	(0,00)
(2)	E-mini Euro Future March 2023	(613)	(0,00)
1	E-mini Materials Future March 2023	(680)	(0,00)
(8)	E-mini Russell 2000 Index Future March 2023	(7.541)	(0,00)
(480)	Euro Bund Futures January 2023	(2.616.082)	(0,09)
480	Euro Bund Futures January 2023	(448.128)	(0,01)
(6)	Euro Currency Future March 2023	(410)	(0,00)
(1.068)	Euro FX Currency Future March 2023	(1.770.924)	(0,06)
(1.600)	Euro STOXX 50 Dividend Index Future December 2023	(3.664)	(0,00)
1.600	Euro STOXX 50 Dividend Index Future December 2023	(608.672)	(0,02)
2	Euro STOXX 50 Future January 2023	(3.001)	(0,00)
238	Euro STOXX 50 Future March 2023	(161.876)	(0,01)
(160)	Euro STOXX 50 Index Dividend Future December 2024	(10.246)	(0,00)
166	Euro STOXX 50 Index Dividend Future December 2025	(8.730)	(0,00)
(1)	Euro/Japanese Yen Currency Future March 2023	(104)	(0,00)
48	Euro-Bund Future March 2023	(329.289)	(0,01)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,81 %) (31. Dezember 2021: (1,34 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
7	Euro-OAT Future March 2023	(65.427)	(0,00)
(11)	FTSE China A50 Index Future July 2023	(1.731)	(0,00)
53	FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2023	(45.657)	(0,00)
2	FTSE/MIB Index Future March 2023	(4.184)	(0,00)
(32)	Hang Seng China Enterprises Index Future February 2023	(8.597)	(0,00)
204	Hang Seng Index Future February 2023	(55.565)	(0,00)
(2)	Indian Rupee Currency Future July 2023	(56)	(0,00)
139	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2023	(933.040)	(0,03)
(1.158)	Japanese Yen Currency Future March 2023	(4.988.802)	(0,16)
74	KOSPI 200 Index Future March 2023	(93.940)	(0,00)
50	KOSPI 200 Mini Future January 2023	(24.641)	(0,00)
(16)	Mexican Peso Currency Future March 2023	(395)	(0,00)
1	Mini-Hang Seng China Enterprises Index Future February 2023	(110)	(0,00)
11	Mini-Hang Seng Index Future January 2023	(655)	(0,00)
22	MSCI EAFE Index Future March 2023	(20.620)	(0,00)
74	MSCI Emerging Markets Index Future March 2023	(42.080)	(0,00)
6	MSCI Singapore Index Future February 2023	(1.342)	(0,00)
(113)	Nasdaq 100 E-mini Future March 2023	(31.860)	(0,00)
(29)	New Zealand Dollar Currency Future March 2023	(15.557)	(0,00)
3	Nikkei 225 (CME) Future March 2023	(7.575)	(0,00)
3	Nikkei 225 (OSE) Future March 2023	(31.831)	(0,00)
34	Nikkei 225 (SGX) Future March 2023	(49.793)	(0,00)
18	Norwegian Krone Currency Future March 2023	(25.188)	(0,00)
(1)	NYSE FANG+ Index Future March 2023	(511)	(0,00)
72	OMXS30 Index Future February 2023	(41.520)	(0,00)
(1)	S&P 500 Consumer Staples Index March 2023	(150)	(0,00)
177	S&P 500 E-mini Future March 2023	(40.000)	(0,00)
4	S&P 500 Micro E-mini Future March 2023	(221)	(0,00)
12	S&P E-mini S&P MidCap 400 Future March 2023	(5.940)	(0,00)
2	S&P Real Estate Sector E-mini Future March 2023	(625)	(0,00)
152	S&P/TSX 60 Index Future March 2023	(531.382)	(0,02)
(36)	SGX FTSE Taiwan Future January 2023	(1.100)	(0,00)
3	Short-Term Euro-BTP Future March 2023	(1.644)	(0,00)
34	SPI 200 Index Future March 2023	(22.498)	(0,00)
(7)	Swiss Franc Currency Future March 2023	(7.821)	(0,00)
3	TAIEX Future January 2023	(1.064)	(0,00)
1	TOPIX Index Future March 2023	(644)	(0,00)
877	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	(2.704.314)	(0,09)
84	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(133.125)	(0,01)
1.010	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	(844.997)	(0,03)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,81 %) (31. Dezember 2021: (1,34 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(33)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	(17.125)	(0,00)
264	VSTOXX Future February 2023	(20.167)	(0,00)
801	VSTOXX Future January 2023	(184.244)	(0,01)
1.258	VSTOXX Future March 2023	(157.560)	(0,01)
101	Yen Denominated Nikkei Future March 2023	(233.387)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±</b>		<b>(25.288.052)</b>	<b>(0,81)</b>

### Verkaufte Optionskontrakte (9,90 %) (31. Dezember 2021: (14,20 %))

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufoptionen</b>				
(9.600)	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(1.550.000)	(0,05)
(6.700)	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(460.625)	(0,01)
(3.000)	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$96 ±	(18.750)	(0,00)
(111)	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$65 ±	(34.965)	(0,00)
(92)	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$78 ±	(2.438)	(0,00)
(153)	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$100 ±	(100.215)	(0,00)
(400.000)	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$101 ∞	(2.568.201)	(0,08)
(166.666)	18.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$97 ∞	(1.308.210)	(0,04)
(166.667)	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$97 ∞	(1.329.855)	(0,04)
(166.667)	22.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$97 ∞	(1.339.331)	(0,04)
(400.000)	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$38 ∞	(9.528.211)	(0,31)
(433)	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$18 ±	(22.733)	(0,00)
(341)	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$21 ±	(682)	(0,00)
(15)	20.01.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$480 ±	(122.475)	(0,00)
(450.000)	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$92 ∞	(2.749.471)	(0,09)
(8)	17.03.2023	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,660 ±	(11.280)	(0,00)
(167)	20.01.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$42 ±	(93.938)	(0,00)
(117.000)	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price \$100 ∞	(557.041)	(0,02)
(117.000)	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price \$100 ∞	(569.463)	(0,02)
(116.000)	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price \$100 ∞	(572.292)	(0,02)
(210.000)	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price \$139 ∞	(3.165.713)	(0,10)
(75)	20.01.2023	CVS Caremark Corp, Strike Price \$95 ±	(8.700)	(0,00)
(1.395.000)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	(5.752.520)	(0,18)
(1.395.000)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	(5.963.219)	(0,19)
(47.566)	16.06.2023	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR22 ±	(304.589)	(0,01)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (9,90 %) (31. Dezember 2021: (14,20 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(29)	20.01.2023	Dollar General Corp, Strike Price \$250 ±	(12.325)	(0,00)
(40.000)	17.03.2023	Dow Jones EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR115 ∞	(96.423)	(0,00)
(220)	17.03.2023	Eastman Chemical Co, Strike Price \$75 ±	(202.400)	(0,01)
(110.000)	19.09.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	(2.140.046)	(0,07)
(110.000)	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	(2.160.247)	(0,07)
(110.000)	19.11.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	(2.187.699)	(0,07)
(35.000)	20.12.2024	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,200 ∞	(945.837)	(0,03)
(156)	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,725 ±	(288.862)	(0,01)
(200.000)	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$95 ∞	(153.380)	(0,00)
(35)	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,700 ±	(54.933)	(0,00)
(20)	20.01.2023	Hang Seng Index Future, Strike Price HKD19,500 ±	(102.371)	(0,00)
(477)	13.03.2023	IMM Euro Index Future, Strike Price \$95 ±	(536.625)	(0,02)
(200.000)	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$231 ∞	(19.432.827)	(0,63)
(150.000)	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$250 ∞	(12.721.550)	(0,41)
(20)	17.03.2023	Lithia Motors Inc, Strike Price \$195 ±	(48.300)	(0,00)
(2.354)	17.03.2023	Lumen Technologies Inc, Strike Price \$7 ±	(22.363)	(0,00)
(800.000)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$32 ∞	(245.197)	(0,01)
(1.000.000)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$40 ∞	(161.924)	(0,01)
(91)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$48 ±	(2.457)	(0,00)
(180)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$60 ±	(2.520)	(0,00)
(275.950)	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$137 ∞	(5.728.739)	(0,18)
(240.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$111 ∞	(102.417)	(0,00)
(400.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$117 ∞	(131.332)	(0,00)
(350.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$145 ∞	(42.241)	(0,00)
(132)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$170 ±	(5.082)	(0,00)
(238)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$220 ±	(0)	(0,00)
(50)	17.03.2023	McDonalds Corp, Strike Price \$260 ±	(63.625)	(0,00)
(298)	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$55 ±	(528.950)	(0,02)
(202)	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$65 ±	(174.730)	(0,01)
(65)	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$245 ±	(82.225)	(0,00)
(28)	20.01.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$255 ±	(4.886)	(0,00)
(46)	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$290 ±	(6.141)	(0,00)
(240.000)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$140 ∞	(5.013.765)	(0,16)
(300.000)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$150 ∞	(4.977.415)	(0,16)
(225.000)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$151 ∞	(3.643.426)	(0,12)
(361)	20.01.2023	NortonLifeLock Inc, Strike Price \$27 ±	(0)	(0,00)
(200.000)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$172 ∞	(314.524)	(0,01)
(250.000)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$174 ∞	(379.031)	(0,01)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (9,90 %) (31. Dezember 2021: (14,20 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(133)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$250 ±	(5.652)	(0,00)
(1.500.000)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$25 ∞	(3.503.778)	(0,11)
(1.200.000)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$28 ∞	(820.179)	(0,03)
(6.623)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$35 ±	(6.623)	(0,00)
(2.540)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$37 ±	(0)	(0,00)
(267)	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$63 ±	(83.438)	(0,00)
(178)	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$75 ±	(1.780)	(0,00)
(635)	17.03.2023	Rocket Companies Inc, Strike Price \$11 ±	(4.445)	(0,00)
(4)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,820 ±	(19.950)	(0,00)
(5)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,910 ±	(13.063)	(0,00)
(23)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,000 ±	(24.725)	(0,00)
(12)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,050 ±	(7.050)	(0,00)
(79)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,090 ±	(26.663)	(0,00)
(13)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,800 ±	(130.650)	(0,00)
(80)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,800 ±	(2.295.600)	(0,07)
(24)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,870 ±	(353.640)	(0,01)
(5)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,950 ±	(100.975)	(0,00)
(16)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,960 ±	(163.760)	(0,01)
(1)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,960 ±	(14.175)	(0,00)
(6)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,990 ±	(76.500)	(0,00)
(4)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,025 ±	(65.880)	(0,00)
(15)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,125 ±	(66.750)	(0,00)
(9)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,150 ±	(1.912)	(0,00)
(10)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,200 ±	(1.075)	(0,00)
(36)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 ±	(900)	(0,00)
(48)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 ±	(51.600)	(0,00)
(7)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 ±	(36.295)	(0,00)
(8)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,400 ±	(14.440)	(0,00)
(6)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,425 ±	(22.350)	(0,00)
(8)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,500 ±	(80)	(0,00)
(2)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,550 ±	(1.510)	(0,00)
(21)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,750 ±	(157)	(0,00)
(33)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,750 ±	(3.300)	(0,00)
(18)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,850 ±	(135)	(0,00)
(23)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,900 ±	(1.150)	(0,00)
(7)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$5,150 ±	(35)	(0,00)
(25)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$5,200 ±	(125)	(0,00)
(400.000)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$73 ∞	(26.439.443)	(0,84)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (9,90 %) (31. Dezember 2021: (14,20 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(157)	20.01.2023	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$65 ±	(942)	(0,00)
(82)	20.01.2023	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$80 ±	(328)	(0,00)
(94)	20.01.2023	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$95 ±	(470)	(0,00)
(32)	16.06.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR14 ±	(15.027)	(0,00)
(1.761)	17.03.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR15 ±	(577.924)	(0,02)
(400.000)	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$33 ∞	(862.639)	(0,03)
(27)	04.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,050 ±	(6.940)	(0,00)
(37)	30.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,200 ±	(13.724)	(0,00)
(106)	17.03.2023	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$125 ±	(19.875)	(0,00)
(312.085)	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price \$122 ∞	(11.150.572)	(0,36)
NOK (102.000.000)	17.01.2023	United States Dollar/Norwegian Krone Currency Option, Strike Price \$10 ∞	(247.165)	(0,01)
(638)	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$21 ±	(325.380)	(0,01)
(536)	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$25 ±	(141.504)	(0,01)
(180.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$165 ∞	(76.275)	(0,00)
(160.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$198 ∞	(37.872)	(0,00)
(200.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$199 ∞	(46.623)	(0,00)
(15)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$320 ±	(412)	(0,00)
(290)	17.03.2023	Wells Fargo & Co, Strike Price \$45 ±	(26.825)	(0,00)
(48)	17.03.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$58 ±	(127.080)	(0,00)
(261)	17.03.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$65 ±	(520.695)	(0,02)
(93)	20.01.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$70 ±	(122.760)	(0,00)
(105)	20.01.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$83 ±	(37.537)	(0,00)
(134)	20.01.2023	XPO Logistics Inc, Strike Price \$65 ±	(1.876)	(0,00)
(113)	20.01.2023	XPO Logistics Inc, Strike Price \$65 ±	(0)	(0,00)
<b>Verkaufsoptionen</b>				
(1.600)	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(140.000)	(0,00)
(6.700)	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(1.085.000)	(0,03)
(72.044)	18.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$110 ∞	(1.726.190)	(0,06)
(71.992)	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$110 ∞	(1.712.196)	(0,06)
(71.923)	22.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$110 ∞	(1.710.609)	(0,06)
(160.358)	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$115 ∞	(4.424.931)	(0,15)
(46.946)	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$43 ∞	(487.410)	(0,01)
(126.665)	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105 ∞	(5.082.702)	(0,16)
(11.700)	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price \$76 ∞	(568.032)	(0,02)
(11.700)	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price \$76 ∞	(568.620)	(0,02)
(11.600)	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price \$76 ∞	(564.018)	(0,02)
(70.547)	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price \$111 ∞	(2.096.251)	(0,07)
(1.448.995)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11 ∞	(572.943)	(0,02)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (9,90 %) (31. Dezember 2021: (14,20 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(1.448.995)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11 <sup>∞</sup>	(607.667)	(0,02)
(1.448.995)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR12 <sup>∞</sup>	(708.634)	(0,02)
(1.448.995)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR12 <sup>∞</sup>	(748.742)	(0,02)
(92.400)	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 <sup>∞</sup>	(1.737.654)	(0,06)
(600)	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR2,600 <sup>±</sup>	(23.053)	(0,00)
(330)	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,150 <sup>±</sup>	(57.055)	(0,00)
(544)	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,600 <sup>±</sup>	(96.377)	(0,00)
(1.020)	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,650 <sup>±</sup>	(273.237)	(0,01)
(66)	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,725 <sup>±</sup>	(80.159)	(0,00)
(29.267)	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$108 <sup>∞</sup>	(2.211.678)	(0,07)
(1.792)	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,300 <sup>±</sup>	(746.193)	(0,02)
(50)	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,700 <sup>±</sup>	(60.539)	(0,00)
(22)	20.01.2023	Hang Seng Index Future, Strike Price HKD19,500 <sup>±</sup>	(54.824)	(0,00)
(477)	13.03.2023	IMM Euro Index Future, Strike Price \$95 <sup>±</sup>	(32.794)	(0,00)
(41.929)	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$294 <sup>∞</sup>	(1.872.074)	(0,07)
(34.328)	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$319 <sup>∞</sup>	(1.943.623)	(0,06)
(168.821)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$42 <sup>∞</sup>	(4.820.839)	(0,16)
(214.527)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$56 <sup>∞</sup>	(9.120.587)	(0,29)
(76.564)	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$153 <sup>∞</sup>	(2.054.928)	(0,07)
(76.632)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$126 <sup>∞</sup>	(5.974.564)	(0,19)
(124.502)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$133 <sup>∞</sup>	(10.563.030)	(0,34)
(103.560)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$164 <sup>∞</sup>	(11.822.462)	(0,38)
(68.636)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$178 <sup>∞</sup>	(2.998.863)	(0,09)
(76.824)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$192 <sup>∞</sup>	(4.171.853)	(0,13)
(75.004)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$193 <sup>∞</sup>	(4.141.774)	(0,13)
(5)	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY26,250 <sup>±</sup>	(16.674)	(0,00)
(10)	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,250 <sup>±</sup>	(90.568)	(0,00)
(15)	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,750 <sup>±</sup>	(189.852)	(0,01)
(49.339)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$220 <sup>∞</sup>	(6.972.022)	(0,23)
(64.205)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$223 <sup>∞</sup>	(9.220.428)	(0,30)
(75.000)	21.11.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$194 <sup>∞</sup>	(4.261.408)	(0,14)
(750.000)	16.05.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$99 <sup>∞</sup>	(8.516.120)	(0,27)
(368.894)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$29 <sup>∞</sup>	(874.598)	(0,03)
(291.934)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$31 <sup>∞</sup>	(1.313.468)	(0,04)
(635)	17.03.2023	Rocket Companies Inc, Strike Price \$5 <sup>±</sup>	(10.478)	(0,00)
(320)	31.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,400 <sup>±</sup>	(84.000)	(0,00)
(270)	31.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,750 <sup>±</sup>	(678.375)	(0,02)
(850)	17.02.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,750 <sup>±</sup>	(3.325.625)	(0,11)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte (9,90 %) (31. Dezember 2021: (14,20 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(4)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,840 ±	(13.350)	(0,00)
(157)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,890 ±	(708.463)	(0,02)
(6)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,750 ±	(5.280)	(0,00)
(14)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,775 ±	(28.840)	(0,00)
(18)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,825 ±	(41.130)	(0,00)
(69)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,900 ±	(41.400)	(0,00)
(42)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,950 ±	(28.140)	(0,00)
(396)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,300 ±	(837.540)	(0,03)
(8)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,350 ±	(60.000)	(0,00)
(88)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,360 ±	(236.280)	(0,01)
(2)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,360 ±	(9.270)	(0,00)
(13)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,390 ±	(66.105)	(0,00)
(6)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,425 ±	(53.460)	(0,00)
(20)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,500 ±	(11.200)	(0,00)
(19)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,600 ±	(22.705)	(0,00)
(47)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,600 ±	(315.605)	(0,01)
(24)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,800 ±	(134.520)	(0,00)
(15)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,850 ±	(115.425)	(0,00)
(31)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,850 ±	(457.715)	(0,02)
(15)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,855 ±	(224.625)	(0,01)
(16)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,860 ±	(243.120)	(0,01)
(24)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,870 ±	(375.120)	(0,01)
(18)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,950 ±	(241.290)	(0,01)
(6)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,950 ±	(153.840)	(0,01)
(16)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,960 ±	(320.720)	(0,01)
(1)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,960 ±	(22.575)	(0,00)
(4)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,990 ±	(96.420)	(0,00)
(4)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,025 ±	(116.940)	(0,00)
(9)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,125 ±	(275.625)	(0,01)
(5)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,150 ±	(153.250)	(0,01)
(5)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,200 ±	(177.700)	(0,01)
(17)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,225 ±	(654.840)	(0,02)
(7)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,450 ±	(422.660)	(0,01)
(3)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,500 ±	(196.080)	(0,01)
(6)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,550 ±	(421.770)	(0,01)
(2)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,600 ±	(150.660)	(0,01)
(48.561)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$83 °°	(370.948)	(0,01)
(67.492)	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$38 °°	(1.316.595)	(0,04)



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (9,90 %) (31. Dezember 2021: (14,20 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(16)	04.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,000 ±	(1.041)	(0,00)
(10)	04.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,050 ±	(878)	(0,00)
(31)	30.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,100 ±	(12.456)	(0,00)
(7)	30.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,700 ±	(7.060)	(0,00)
(1.152)	17.03.2023	The Walt Disney Company, Strike Price \$13 ±	(109.440)	(0,00)
(400.000)	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price \$116 ±	(2.883.242)	(0,09)
(41.564)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$210 ±	(6.946.560)	(0,23)
(87.267)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$253 ±	(18.113.554)	(0,59)
<b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: 481.736.345 US\$)</b>			<b>(309.983.118)</b>	<b>(9,90)</b>

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank und UBS AG.

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %))

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(390.571)	1Life Healthcare Inc	Goldman Sachs International	(9.022)	(0,00)
(9.700)	77 Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(26.307)	(0,00)
1.023.210	A O Smith Corp	Goldman Sachs International	(25.666)	(0,00)
376.328	Abbott Laboratories	Morgan Stanley	(38.380)	(0,00)
3.785.652	Abbott Laboratories	Goldman Sachs International	(203.786)	(0,01)
201.136	Abbott Laboratories	JPMorgan Chase Bank	(10.787)	(0,00)
255.472	AbbVie Inc	Goldman Sachs International	(862)	(0,00)
1.070.513	AbbVie Inc	Morgan Stanley	(58.414)	(0,00)
127.010	AbbVie Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.763)	(0,00)
(200)	ABC-Mart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(922)	(0,00)
(2.828.544)	Absa Group Ltd	Goldman Sachs International	(8.000)	(0,00)
(2.074.765)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs International	(36.723)	(0,00)
23.131	Accenture Plc Class A	Morgan Stanley	(1.060)	(0,00)
142.876	Accor SA	Morgan Stanley	(2.991)	(0,00)
(16.200)	Acom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(857)	(0,00)
(656.801)	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs International	(4.956)	(0,00)
(50.503)	AdaptHealth Corp	JPMorgan Chase Bank	(4.170)	(0,00)
(355.725)	AdaptHealth Corp	Goldman Sachs International	(26.161)	(0,00)
(136.038)	AdaptHealth Corp	Morgan Stanley	(16.952)	(0,00)
(800)	Adastria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.191)	(0,00)
(15.300)	Adeia Inc	Morgan Stanley	(87.822)	(0,00)
(5.900)	ADEKA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(761)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
532.194	Adobe Inc	Morgan Stanley	(205.942)	(0,01)
3.017.838	Advance Auto Parts Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.409)	(0,00)
4.569.817	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	(28.960)	(0,00)
15.767	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs International	(240)	(0,00)
(1.327.458)	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	(61.497)	(0,00)
(1.246.839)	Advanced Micro Devices Inc	JPMorgan Chase Bank	(39.162)	(0,00)
(4.200)	Advantest Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17.627)	(0,00)
30.543.889	Advantest Corp	JPMorgan Chase Bank	(6.278)	(0,00)
1.000	Adventure Inc	Bank of America Merrill Lynch	(260)	(0,00)
(232.838)	Adyen NV	JPMorgan Chase Bank	(32.743)	(0,00)
(179.868)	Adyen NV	Goldman Sachs International	(12.170)	(0,00)
(13.600)	AECOM	Morgan Stanley	(231)	(0,00)
(98.595)	Aemetis Inc	Goldman Sachs International	(85.742)	(0,00)
(5.678.065)	Aemetis Inc	Morgan Stanley	(4.611.604)	(0,15)
(22.500)	Aeon Mall Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9.774)	(0,00)
(10.800)	AES Corp	Morgan Stanley	(182)	(0,00)
634.879	AGCO Corp	JPMorgan Chase Bank	(28.236)	(0,00)
2.766.281	AGCO Corp	Goldman Sachs International	(552.048)	(0,02)
(2.577.045)	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs International	(88.942)	(0,01)
(485.566)	Agilent Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.076)	(0,00)
(2.773.850)	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	(113.312)	(0,01)
(700)	Ai Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(88)	(0,00)
(4.493.808)	Air France-KLM	Goldman Sachs International	(7.789)	(0,00)
(684.685)	Airbus SE	Morgan Stanley	(19.037)	(0,00)
3.500	Aisin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(703)	(0,00)
31.295	Akamai Technologies Inc	Morgan Stanley	(10.041)	(0,00)
236.676	Akero Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(24.039)	(0,00)
209.724	Akero Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(35.873)	(0,00)
132.376	Alfen Beheer BV	JPMorgan Chase Bank	(26.418)	(0,00)
(3.800)	Alfresa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(323)	(0,00)
(2.376.126)	Alibaba Group Holding Ltd	Goldman Sachs International	(152.371)	(0,01)
(560.039)	Alibaba Group Holding Ltd	JPMorgan Chase Bank	(4.056)	(0,00)
2.522.849	Align Technology Inc	Morgan Stanley	(261.475)	(0,01)
194.265	Align Technology Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.585)	(0,00)
(246.100)	Alignment Healthcare Inc	Morgan Stanley	(6.625)	(0,00)
316.916	Allegion plc	Morgan Stanley	(44.032)	(0,00)
1.532.881	Allegion plc	Goldman Sachs International	(85.026)	(0,00)
23.193	Allegro MicroSystems Inc	Morgan Stanley	(23)	(0,00)
4.255.017	Allegro.eu SA	JPMorgan Chase Bank	(69.222)	(0,00)
108.282	Allegro.eu SA	Goldman Sachs International	(1.919)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
410.143	Allegro.eu SA	Morgan Stanley	(5.054)	(0,00)
474.345	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(54.332)	(0,00)
615.354	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(173)	(0,00)
217	Alnylam Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(20)	(0,00)
120.178	Alphabet Inc Class A	Morgan Stanley	(286)	(0,00)
(257.291)	Alphabet Inc Class C	JPMorgan Chase Bank	(33.053)	(0,00)
(357.282)	Alstom SA	Goldman Sachs International	(14.362)	(0,00)
(4.300)	Amano Corp	Bank of America Merrill Lynch	(741)	(0,00)
966.599	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	(33.252)	(0,00)
(4.549.249)	American Homes 4 Rent	Goldman Sachs International	(274.994)	(0,01)
10.475	American States Water Co	Morgan Stanley	(969)	(0,00)
174.229	American States Water Co	JPMorgan Chase Bank	(10.610)	(0,00)
(28.100)	Amkor Technology Inc	Morgan Stanley	(401)	(0,00)
(272.979)	Amphastar Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.236)	(0,00)
263.309	Amphenol Corp Class A	Morgan Stanley	(432)	(0,00)
287.094	Amphenol Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(24.737)	(0,00)
(1.052.543)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(33.164)	(0,00)
202.988	Andritz AG	Morgan Stanley	(16.288)	(0,00)
(77.618)	Anglo American Plc	Morgan Stanley	(1.343)	(0,00)
(6.640)	Anglo American Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.764)	(0,00)
25.900	Anritsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.372)	(0,00)
88.286	Antero Midstream Corp	JPMorgan Chase Bank	(2.096)	(0,00)
60.329	Antero Midstream Corp	Goldman Sachs International	(2.856)	(0,00)
37.501	Antero Midstream Corp	Morgan Stanley	(885)	(0,00)
(5.369)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.230)	(0,00)
(59)	AP Moller - Maersk A/S Class B	Morgan Stanley	(14.779)	(0,00)
(18.700)	Apollo Medical Holdings Inc	Morgan Stanley	(37)	(0,00)
316.610	Apple Inc	Morgan Stanley	(5.070)	(0,00)
15.727	Apple Inc	Goldman Sachs International	(131)	(0,00)
63.113	Apple Inc	JPMorgan Chase Bank	(62)	(0,00)
290.426	Applied Materials Inc	JPMorgan Chase Bank	(39.675)	(0,00)
942.239	Aptiv Plc	JPMorgan Chase Bank	(27.890)	(0,00)
(73.075)	ArcelorMittal SA	Morgan Stanley	(5.526)	(0,00)
3.400	Ariake Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.274)	(0,00)
67.449	Arista Networks Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.575)	(0,00)
91.808	Array Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.210)	(0,00)
(40.614)	Array Technologies Inc	Morgan Stanley	(3.312)	(0,00)
232.242	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(31.070)	(0,00)
241.246	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(71.911)	(0,00)
(349.588)	Arvinas Inc	JPMorgan Chase Bank	(45.518)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(245.893)	Arvinas Inc	Goldman Sachs International	(23.253)	(0,00)
1.300	Asahi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(129)	(0,00)
4.800	Asahi Intecc Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.783)	(0,00)
(500)	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25)	(0,00)
(7.362)	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.152)	(0,00)
(5.200)	Asics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(757)	(0,00)
(6.100)	ASKUL Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.373)	(0,00)
(381.095)	ASML Holding NV	Morgan Stanley	(77.399)	(0,00)
(15.870)	ASML Holding NV	JPMorgan Chase Bank	(1.144)	(0,00)
(488.939)	ASML Holding NV	Goldman Sachs International	(31.759)	(0,00)
26.957	ASOS Plc	Bank of America Merrill Lynch	(26.783)	(0,00)
(838.798)	Assa Abloy AB Class B	Morgan Stanley	(60.053)	(0,00)
172.397	Assura Plc	Bank of America Merrill Lynch	(316)	(0,00)
(6.260)	AstraZeneca Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.428)	(0,00)
(711.199)	AT&T Inc	JPMorgan Chase Bank	(87.799)	(0,00)
136.714	AT&T Inc	Morgan Stanley	(2.218)	(0,00)
(504.059)	Atlas Copco AB Class A	Morgan Stanley	(25.942)	(0,00)
13.800	Atlassian Corp Class A	Morgan Stanley	(18.942)	(0,00)
(343.486)	Atlassian Corp Plc Class A	JPMorgan Chase Bank	(120.939)	(0,01)
596.701	Autohome Inc	JPMorgan Chase Bank	(26.527)	(0,00)
301.741	AutoStore Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	(7.025)	(0,00)
570.257	AutoStore Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(21.943)	(0,00)
47.102	AutoStore Holdings Ltd	Morgan Stanley	(81)	(0,00)
2.331.911	AutoZone Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.940)	(0,00)
(24.210)	AVEVA Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11.637)	(0,00)
83.677	Aviva Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.132)	(0,00)
198.685	Axcelis Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.052)	(0,00)
989.871	Axfood AB	Morgan Stanley	(1.269)	(0,00)
11.361	Axon Enterprise Inc	Morgan Stanley	(37.791)	(0,00)
223.303	Axsome Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(19.704)	(0,00)
9.900	Azbil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21.650)	(0,00)
(7.100)	AZ-COM MARUWA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.448)	(0,00)
(27.407)	B&M European Value Retail SA	Bank of America Merrill Lynch	(587)	(0,00)
(74.797)	Balanced Commercial Property Trust Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.466)	(0,00)
3.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Société Générale	(178.066)	(0,01)
1.200	Bandai Namco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(411)	(0,00)
326.970	Bank of America Corp	JPMorgan Chase Bank	(11.350)	(0,00)
506	Bank of Georgia Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(175)	(0,00)
319.930	Bank of New York Mellon Corp	JPMorgan Chase Bank	(6.891)	(0,00)
677.191	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs International	(104.402)	(0,01)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
602.444	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	(93.671)	(0,01)
(6.183.248)	Bank Pekao SA	JPMorgan Chase Bank	(32.123)	(0,00)
3.570	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	(695)	(0,00)
367.740	Bath & Body Works Inc	Morgan Stanley	(4.289)	(0,00)
(1.994.700)	Baxter International Inc	Goldman Sachs International	(98.039)	(0,01)
(683.906)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	(45.889)	(0,00)
(827.757)	Bayer AG	JPMorgan Chase Bank	(81.449)	(0,00)
(380.891)	Bayer AG	Morgan Stanley	(5.519)	(0,00)
682.143	Bayerische Motoren Werke AG	JPMorgan Chase Bank	(20.185)	(0,00)
(156.775)	BE Semiconductor Industries NV	Morgan Stanley	(6.807)	(0,00)
(221.088)	Beauty Health Co	Goldman Sachs International	(52.098)	(0,00)
(247.873)	Beauty Health Co	Morgan Stanley	(95.464)	(0,01)
(413.354)	Beauty Health Co	JPMorgan Chase Bank	(153.012)	(0,01)
(80.857)	Beazley Plc	Bank of America Merrill Lynch	(76.198)	(0,00)
804.919	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	(3.614)	(0,00)
2.311.417	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs International	(87.081)	(0,00)
690.370	BeiGene Ltd	JPMorgan Chase Bank	(8.487)	(0,00)
(138.266)	Beijer Ref AB	Morgan Stanley	(3.263)	(0,00)
(665.577)	Belimo Holding AG	Morgan Stanley	(60.049)	(0,00)
(1.600)	Benesse Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(423)	(0,00)
1.800	BeNext-Yumeshin Group Co	Bank of America Merrill Lynch	(591)	(0,00)
4.200	Bengo4.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37.110)	(0,00)
5.800	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	(678)	(0,00)
(448.640)	BHP Group Ltd	Morgan Stanley	(904)	(0,00)
(42.866)	BHP Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(188.613)	(0,01)
(17.500)	Bic Camera Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.820)	(0,00)
7.157	Biffa Plc	Bank of America Merrill Lynch	(318)	(0,00)
5.157	Big Yellow Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(822)	(0,00)
(937.068)	Bill.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(40.245)	(0,00)
(539.193)	Biogen Inc	JPMorgan Chase Bank	(22.119)	(0,00)
(1.789.054)	Biogen Inc	Morgan Stanley	(43.032)	(0,00)
(4.445.084)	Biogen Inc	Goldman Sachs International	(277.312)	(0,01)
323.480	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	(3.669)	(0,00)
635.655	BioMarin Pharmaceutical Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.777)	(0,00)
237.409	Bio-Techne Corp	JPMorgan Chase Bank	(12.489)	(0,00)
(3.000)	BIPROGY Inc	Bank of America Merrill Lynch	(795)	(0,00)
(1.999.095)	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Morgan Stanley	(138.972)	(0,01)
(482.993)	Black Knight Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.303)	(0,00)
367.245	BlackRock Inc	Goldman Sachs International	(16.290)	(0,00)
276.383	BlackRock Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.377)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
523.126	BlackRock Inc	Morgan Stanley	(40.855)	(0,00)
(317.724)	Block Inc	JPMorgan Chase Bank	(21.387)	(0,00)
416.487	Block Inc	Morgan Stanley	(9.715)	(0,00)
(500)	BML Inc	Bank of America Merrill Lynch	(165)	(0,00)
(11.181.500)	BNP Paribas SA	Morgan Stanley	(13.286)	(0,00)
558.399	Boliden AB	JPMorgan Chase Bank	(3.329)	(0,00)
981.682	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	(39.558)	(0,00)
496.789	Booking Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.838)	(0,00)
(15.568.635)	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs International	(815.549)	(0,03)
(730.188)	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs International	(14.922)	(0,00)
(1.093.726)	Boston Scientific Corp	Morgan Stanley	(16.617)	(0,00)
150.281	Bowlero Corp	Morgan Stanley	(6.643)	(0,00)
102.230	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	(2.100)	(0,00)
(871.087)	BP Plc	Goldman Sachs International	(24.592)	(0,00)
(71.605)	BP Plc	Morgan Stanley	(3.975)	(0,00)
(541.628)	Brenntag SE	Morgan Stanley	(10.586)	(0,00)
(266.544)	Brenntag SE	JPMorgan Chase Bank	(15.958)	(0,00)
3.700	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.945)	(0,00)
60.191	British Land Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.240)	(0,00)
(3.284.451)	Brixmor Property Group Inc	Goldman Sachs International	(13.798)	(0,00)
(9.100)	Brixmor Property Group Inc	Morgan Stanley	(202)	(0,00)
927.194	Broadcom Inc	Morgan Stanley	(38.371)	(0,00)
1.581.674	Broadcom Inc	JPMorgan Chase Bank	(70.391)	(0,00)
10.800	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.884)	(0,00)
(486.334)	BRP Inc	Morgan Stanley	(4.848)	(0,00)
2.361.963	Brunswick Corp	JPMorgan Chase Bank	(20.212)	(0,00)
54.641	BT Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.514)	(0,00)
7.437	Bunzl Plc	Bank of America Merrill Lynch	(15.442)	(0,00)
9.045	Burberry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11.553)	(0,00)
6.104	Burford Capital Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.205)	(0,00)
(3.900)	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.296)	(0,00)
11.353	California Water Service Group	Morgan Stanley	(98)	(0,00)
(893.247)	Cameco Corp	Morgan Stanley	(6.337)	(0,00)
2.530.791	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	(295.567)	(0,01)
1.125.521	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	(209.134)	(0,01)
85.809	Campbell Soup Co	JPMorgan Chase Bank	(3.168)	(0,00)
(4.325.271)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	(111.598)	(0,01)
(1.733.619)	Canadian National Railway Co	JPMorgan Chase Bank	(16.157)	(0,00)
(2.574.409)	Canadian National Railway Co	Goldman Sachs International	(117.161)	(0,01)
(77.441)	Canadian Solar Inc	Morgan Stanley	(9.687)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(846.754)	Canadian Solar Inc	JPMorgan Chase Bank	(168.921)	(0,01)
2.300	Canon Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.805)	(0,00)
(117.637)	Capital & Counties Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	(17.018)	(0,00)
(2.933.061)	Capitec Bank Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	(8.434)	(0,00)
(11.714.443)	Capitec Bank Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(21.499)	(0,00)
(728.296)	Capri Holdings Ltd	Morgan Stanley	(4.190)	(0,00)
(50.437)	Capricorn Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.733)	(0,00)
(375.252)	Cardinal Health Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.986)	(0,00)
(3.775.427)	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs International	(118.418)	(0,01)
4.623.717	Carlsberg AS Class B	Morgan Stanley	(13.051)	(0,00)
8.000.000	Carnival Corp	Goldman Sachs International	(20.557)	(0,00)
1.847.971	Carrier Global Corp	Goldman Sachs International	(324.765)	(0,01)
1.557.167	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	(190.690)	(0,01)
(6.300)	Casio Computer Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.932)	(0,00)
6.445	Catalent Inc	Goldman Sachs International	(553)	(0,00)
564.894	Cboe Global Markets Inc	JPMorgan Chase Bank	(31.193)	(0,00)
483.245	Cboe Global Markets Inc	Morgan Stanley	(13.391)	(0,00)
1.312.474	Cboe Global Markets Inc	Goldman Sachs International	(77.856)	(0,00)
307.744	CDW Corp	JPMorgan Chase Bank	(32.499)	(0,00)
229.218	Cedar Fair LP	Morgan Stanley	(4.875)	(0,00)
148.980	Celldex Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(33.796)	(0,00)
13.000.000	Cellnex Telecom SA	Société Générale	(5.224)	(0,00)
(344.809)	Cementir Holding NV	Morgan Stanley	(64.470)	(0,00)
(118.346)	Centamin Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.086)	(0,00)
(1.218.557)	Centene Corp	Goldman Sachs International	(24.875)	(0,00)
5.400	Central Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12.590)	(0,00)
59.749	Certara Inc	JPMorgan Chase Bank	(667)	(0,00)
411.777	Certara Inc	Morgan Stanley	(568)	(0,00)
261.188	ChargePoint Holdings Inc	Morgan Stanley	(10.203)	(0,00)
170.678	ChargePoint Holdings Inc	Goldman Sachs International	(18.184)	(0,00)
3.242.670	Charles River Laboratories International Inc	JPMorgan Chase Bank	(113.858)	(0,01)
1.052.001	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs International	(25.992)	(0,00)
3.326.172	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	(174.811)	(0,01)
57.133	Charter Communications Inc Class A	Goldman Sachs International	(1.020)	(0,00)
72.938	Charter Communications Inc Class A	Morgan Stanley	(3.811)	(0,00)
690.513	Charter Communications Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(15.778)	(0,00)
(769.162)	Chefs' Warehouse Inc	Morgan Stanley	(26.302)	(0,00)
376.630	Chemours Co	Goldman Sachs International	(35.858)	(0,00)
(642.273)	Chesapeake Energy Corp	Goldman Sachs International	(46.199)	(0,00)
(984.687)	Chesapeake Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	(45.945)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(414.365)	Chesapeake Energy Corp	Morgan Stanley	(12.034)	(0,00)
332.146	Chevron Corp	JPMorgan Chase Bank	(9.662)	(0,00)
296.700	Chevron Corp	Morgan Stanley	(2.985)	(0,00)
5.436.934	Chevron Corp	Goldman Sachs International	(473.584)	(0,02)
(1.202.819)	Chewy Inc Class A	Morgan Stanley	(97.797)	(0,00)
(17.000)	Chiba Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.749)	(0,00)
2.900	Chipotle Mexican Grill Inc Class A	Morgan Stanley	(166.600)	(0,01)
(2.300)	Chubb Ltd	Morgan Stanley	(141)	(0,00)
(12.200)	Chubu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.271)	(0,00)
(257.453)	Church & Dwight Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.338)	(0,00)
(254.573)	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	(458)	(0,00)
(260.381)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs International	(6.266)	(0,00)
(185.619)	Cie Financiere Richemont SA	Goldman Sachs International	(789)	(0,00)
(489.281)	Cie Financiere Richemont SA	Morgan Stanley	(4.807)	(0,00)
(253.191)	Cie Financiere Richemont SA Class A	Morgan Stanley	(4.193)	(0,00)
714.333	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Morgan Stanley	(36.749)	(0,00)
(101.782)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Goldman Sachs International	(25.161)	(0,00)
1.360.960	Cigna Corp	Morgan Stanley	(21.182)	(0,00)
4.055.052	Cigna Corp	Goldman Sachs International	(112.187)	(0,01)
187.391	Cintas Corp	Morgan Stanley	(3.221)	(0,00)
222.246	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	(1.066)	(0,00)
(2.800)	Citizen Watch Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(145)	(0,00)
(519.891)	Clean Energy Fuels Corp	Goldman Sachs International	(143.294)	(0,01)
(956.941)	Clean Energy Fuels Corp	JPMorgan Chase Bank	(198.018)	(0,01)
(567.584)	Clean Energy Fuels Corp	Morgan Stanley	(17.300)	(0,00)
(4.857)	Close Brothers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.630)	(0,00)
(342.967)	CME Group Inc	Morgan Stanley	(22.856)	(0,00)
(1.977.682)	CME Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(85.932)	(0,00)
(476.871)	CME Group Inc	Goldman Sachs International	(21.025)	(0,00)
(497.795)	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	(401)	(0,00)
(9.800)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.917)	(0,00)
476.687	Coca-Cola Co	JPMorgan Chase Bank	(22.940)	(0,00)
189.503	Coca-Cola Co	Morgan Stanley	(10.348)	(0,00)
555.633	Coca-Cola Co	Goldman Sachs International	(43.920)	(0,00)
16.100	Cognizant Technology Solutions Corp	Morgan Stanley	(11.664)	(0,00)
357.455	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Morgan Stanley	(1.205)	(0,00)
(1.700)	Colowide Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(267)	(0,00)
531.457	Columbia Banking System Inc	Goldman Sachs International	(23.556)	(0,00)
12.362	Comcast Corp Class A	Goldman Sachs International	(173)	(0,00)
(4.795.632)	Commerzbank AG	Morgan Stanley	(66.432)	(0,00)



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
238.525	Compass Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(14.316)	(0,00)
(4.761)	Computacenter Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.512)	(0,00)
(3.200)	Comture Corp	Bank of America Merrill Lynch	(672)	(0,00)
(29.100)	Concordia Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(988)	(0,00)
139.732	CONMED Corp	Goldman Sachs International	(142)	(0,00)
289.983	CONMED Corp	JPMorgan Chase Bank	(2.208)	(0,00)
(1.314.596)	ConocoPhillips	JPMorgan Chase Bank	(7.472)	(0,00)
(8.291.096)	Constellation Brands Inc Class A	Morgan Stanley	(341.527)	(0,01)
(1.314.029)	Constellation Brands Inc Class A	Goldman Sachs International	(39.827)	(0,00)
(182.090)	Constellation Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	(12.096)	(0,00)
(830.803)	Constellation Energy Corp	Morgan Stanley	(65.873)	(0,00)
548.701	Continental AG	Goldman Sachs International	(74.086)	(0,00)
(4.300)	Contra Abiomed Inc	Morgan Stanley	(6.450)	(0,00)
(56.488)	ConvaTec Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.019)	(0,00)
61.495	Copart Inc	Goldman Sachs International	(11.655)	(0,00)
(437.309)	Corning Inc	Morgan Stanley	(2.787)	(0,00)
1.600	Cosmos Pharmaceutical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.614)	(0,00)
19.697	CoStar Group Inc	Morgan Stanley	(7.918)	(0,00)
4.050.000	Credit Agricole SA	Société Générale	(445.996)	(0,02)
(10.296)	CRH Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.543)	(0,00)
166.140	CRH Plc	Morgan Stanley	(12.829)	(0,00)
261.468	CRH Plc	Goldman Sachs International	(14.226)	(0,00)
563.102	Croda International Plc	Morgan Stanley	(15.552)	(0,00)
73.091	Croda International Plc	Goldman Sachs International	(18.943)	(0,00)
4.168.407	CubeSmart	Goldman Sachs International	(40.253)	(0,00)
165.214	Currys Plc	Bank of America Merrill Lynch	(25.615)	(0,00)
(6.892)	CVS Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(702)	(0,00)
69.940	CVS Health Corp	Morgan Stanley	(22.077)	(0,00)
(200)	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65)	(0,00)
(2.500)	Cybozu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(602)	(0,00)
213.763	Cytokinetics Inc	JPMorgan Chase Bank	(835)	(0,00)
1.800	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(54)	(0,00)
(800)	Daicel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(70)	(0,00)
1.800	Daifuku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.807)	(0,00)
(12.500)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.556)	(0,00)
1.500	Daiichi Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(869)	(0,00)
(900)	Daiichikoshō Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(438)	(0,00)
300	Daikin Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.657)	(0,00)
566.765	Daimler Truck Holding AG	Morgan Stanley	(136.999)	(0,01)
(143.742)	Daimler Truck Holding AG	Goldman Sachs International	(6.590)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
16.200	Daio Paper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20.529)	(0,00)
600	Daito Trust Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(201)	(0,00)
(8.700)	Daiwa House Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.453)	(0,00)
128.550	Danaher Corp	JPMorgan Chase Bank	(4.189)	(0,00)
414.802	Danaher Corp	Morgan Stanley	(7.212)	(0,00)
264.782	Danone SA	JPMorgan Chase Bank	(2.513)	(0,00)
495.045	Danone SA	Goldman Sachs International	(6.138)	(0,00)
3.892	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	(3.308)	(0,00)
3.664	Darktrace Plc	Bank of America Merrill Lynch	(313)	(0,00)
(2.048.514)	Darling Ingredients Inc	JPMorgan Chase Bank	(160.657)	(0,01)
(1.674.728)	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs International	(229.334)	(0,01)
(34.369)	Dassault Aviation SA	Goldman Sachs International	(8.496)	(0,00)
52.258	Datadog Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(3.205)	(0,00)
58.951	Dave & Buster's Entertainment Inc	Morgan Stanley	(1.181)	(0,00)
4.283	DCC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11.499)	(0,00)
414	Definitive Healthcare Corp	Morgan Stanley	(157)	(0,00)
(2.806.104)	Denbury Inc	Morgan Stanley	(280.298)	(0,01)
8.100	Denka Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.472)	(0,00)
1.029.414	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldman Sachs International	(53.132)	(0,00)
(1.303.968)	Deutsche Bank AG	Morgan Stanley	(12.523)	(0,00)
2.498.277	Deutsche Lufthansa AG	Morgan Stanley	(171.810)	(0,01)
475.370	Devon Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	(7.500)	(0,00)
478.781	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	(4.088)	(0,00)
6.300	Dexerials Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16.472)	(0,00)
(24.046)	Diageo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(19.264)	(0,00)
2.500	DIC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(368)	(0,00)
518.160	Dick's Sporting Goods Inc	Morgan Stanley	(4.330)	(0,00)
(6.800)	Digital Garage Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46.338)	(0,00)
96.700	DigitalBridge Group Inc	Morgan Stanley	(18.373)	(0,00)
(364.464)	Dillard's Inc Class A	Morgan Stanley	(43.875)	(0,00)
(863.235)	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	(62.892)	(0,00)
33.104	Direct Line Insurance Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(4.337)	(0,00)
66.177	Direct Line Insurance Group Plc	Morgan Stanley	(12.993)	(0,00)
(75.622.045)	Disco Corp	Morgan Stanley	(940)	(0,00)
2.816.360	Discovery Ltd	JPMorgan Chase Bank	(33.399)	(0,00)
17.500.000	DISH Network Corp	Goldman Sachs International	(9.621)	(0,00)
122.439	DocuSign Inc	Morgan Stanley	(7.843)	(0,00)
152.663	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(619)	(0,00)
(230.075)	Dometic Group AB	Morgan Stanley	(5.022)	(0,00)
(14.478)	DoubleVerify Holdings Inc	Morgan Stanley	(477)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(150.642)	DoubleVerify Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(13.920)	(0,00)
4.956.466	Dover Corp	Morgan Stanley	(562.140)	(0,02)
903.751	Dover Corp	Goldman Sachs International	(58.355)	(0,00)
11.593	Doximity Inc Class A	Morgan Stanley	(715)	(0,00)
245.619	Doximity Inc Class A	Goldman Sachs International	(11.767)	(0,00)
(122.733)	Dr Ing hc F Porsche AG	JPMorgan Chase Bank	(285)	(0,00)
89.741	Dr ING hc F Porsche AG	Morgan Stanley	(45.773)	(0,00)
(374.168)	DraftKings Inc Class A	Morgan Stanley	(86.687)	(0,00)
362.995	Drax Group Plc	Goldman Sachs International	(156.599)	(0,01)
(10.444.142)	DSV A/S	JPMorgan Chase Bank	(27.706)	(0,00)
(50.312)	DSV A/S	Morgan Stanley	(132)	(0,00)
2.200	DTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(221)	(0,00)
(14.126)	Dunelm Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(19.126)	(0,00)
67.127	DuPont de Nemours Inc	Morgan Stanley	(3.358)	(0,00)
(1.400)	Duskin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(360)	(0,00)
715.568	Eagle Bulk Shipping Inc	Goldman Sachs International	(54.258)	(0,00)
(273.221)	Eastern Bankshares Inc	JPMorgan Chase Bank	(29.373)	(0,00)
(31.867)	Eastern Bankshares Inc	Morgan Stanley	(3.348)	(0,00)
(193.713)	EastGroup Properties Inc	Goldman Sachs International	(11.065)	(0,00)
101.965	easyJet Plc	Goldman Sachs International	(405.303)	(0,01)
(1.905.269)	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	(51.648)	(0,00)
(411.406)	eBay Inc	Morgan Stanley	(9.580)	(0,00)
73.682	eBay Inc	Goldman Sachs International	(621)	(0,00)
36.535	Edgewell Personal Care Co	JPMorgan Chase Bank	(104)	(0,00)
(10.200)	EDION Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12.650)	(0,00)
(236.972)	Edwards Lifesciences Corp	JPMorgan Chase Bank	(2.009)	(0,00)
(1.181.431)	Edwards Lifesciences Corp	Morgan Stanley	(6.615)	(0,00)
(400)	Eisai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(337)	(0,00)
(2.800)	Elecom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.044)	(0,00)
(1.026)	Electricite de France SA	Morgan Stanley	(1.163)	(0,00)
(672.052)	Electrolux AB Class B	Morgan Stanley	(13.188)	(0,00)
7.589.477	Electrolux AB Class B	JPMorgan Chase Bank	(37.382)	(0,00)
135.128	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	(230)	(0,00)
3.149.750	Elevance Health Inc	Goldman Sachs International	(51.598)	(0,00)
543.027	elf Beauty Inc	Goldman Sachs International	(150.276)	(0,01)
171.930	elf Beauty Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.396)	(0,00)
(1.753.402)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	(6.549)	(0,00)
(132.995)	Emergent BioSolutions Inc	Morgan Stanley	(1.394)	(0,00)
901.840	Emerson Electric Co	Goldman Sachs International	(149.239)	(0,01)
906.957	Enbridge Inc	Goldman Sachs International	(5.157)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(17.400)	ENEOS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(577)	(0,00)
(19.848)	Energiean Plc	Bank of America Merrill Lynch	(40.134)	(0,00)
841.516	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs International	(97.714)	(0,01)
(806.332)	Energy Transfer LP	Morgan Stanley	(32.660)	(0,00)
(2.540.548)	Energy Transfer LP	JPMorgan Chase Bank	(70.047)	(0,00)
(1.600)	en-japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(659)	(0,00)
16.998	Entain Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.203)	(0,00)
1.138.453	Enviva Inc	JPMorgan Chase Bank	(42.461)	(0,00)
(2.330.425)	EOG Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	(135.818)	(0,01)
(9.800)	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	(1.979)	(0,00)
240.734	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs International	(400)	(0,00)
(167.501)	Epiroc AB Class A	Morgan Stanley	(2.562)	(0,00)
1.602.194	Epiroc AB Class A	Goldman Sachs International	(21.627)	(0,00)
757.286	Epiroc AB Class A	JPMorgan Chase Bank	(11.472)	(0,00)
889.781	EPR Properties	Goldman Sachs International	(2.882)	(0,00)
2.500	eRex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.696)	(0,00)
(982.600)	Erste Group Bank AG	Morgan Stanley	(380)	(0,00)
384.437	EssilorLuxottica SA	Goldman Sachs International	(3.950)	(0,00)
168.393	Essity AB Class B	Morgan Stanley	(656)	(0,00)
341.415	Etsy Inc	Morgan Stanley	(50.203)	(0,00)
(14.500)	euglena Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(199)	(0,00)
416.461	Eurofins Scientific SE	Morgan Stanley	(5.144)	(0,00)
503.475	Evercore Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(14.012)	(0,00)
1.330.022	Evercore Inc Class A	Goldman Sachs International	(49.943)	(0,00)
221.893	Evrax Plc	Morgan Stanley	(215.908)	(0,01)
(1.200)	Exedy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(837)	(0,00)
(930.462)	Exelixis Inc	Goldman Sachs International	(29.912)	(0,00)
(5.900)	EXEO Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.049)	(0,00)
(2.500.000)	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	(20.821)	(0,00)
371.152	Experian Plc	JPMorgan Chase Bank	(2.896)	(0,00)
(1.700)	Ezaki Glico Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.026)	(0,00)
2.342	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	(40.922)	(0,00)
(200)	FANUC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(0,00)
(166.067)	Fate Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(20.991)	(0,00)
(593.699)	Fate Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(231.008)	(0,01)
(408.015)	Faurecia SE	JPMorgan Chase Bank	(88.388)	(0,00)
(17.163)	Faurecia SE	Goldman Sachs International	(3.761)	(0,00)
(5.100)	Financial Partners Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(560)	(0,00)
588.383	First Solar Inc	Morgan Stanley	(17.193)	(0,00)
1.035.528	First Solar Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.514)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
3.867.774	FirstRand Ltd	Goldman Sachs International	(1.919)	(0,00)
215.214	Fiserv Inc	JPMorgan Chase Bank	(8.442)	(0,00)
1.731.930	Five Below Inc	JPMorgan Chase Bank	(92.546)	(0,01)
2.298.001	Five Below Inc	Morgan Stanley	(308.216)	(0,01)
(157.197)	Five9 Inc	Goldman Sachs International	(611)	(0,00)
(16.021)	Five9 Inc	Morgan Stanley	(41)	(0,00)
(507.449)	Flex Ltd	Morgan Stanley	(11.437)	(0,00)
758.183	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(41)	(0,00)
1.506.746	Flowers Foods Inc	Goldman Sachs International	(83.117)	(0,00)
189.366	Flowers Foods Inc	Morgan Stanley	(8.975)	(0,00)
98.995	Flowers Foods Inc	JPMorgan Chase Bank	(16.542)	(0,00)
1.793.218	Foot Locker Inc	JPMorgan Chase Bank	(139.214)	(0,01)
291.142	Ford Motor Co	Morgan Stanley	(406.471)	(0,02)
(436.535)	Fortum Oyj	JPMorgan Chase Bank	(2.064)	(0,00)
12.002	Frasers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.982)	(0,00)
800	Freee KK	Bank of America Merrill Lynch	(992)	(0,00)
(35.097)	Fresnillo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(56.287)	(0,00)
(485.855)	Fugro NV	JPMorgan Chase Bank	(58.446)	(0,00)
2.700	Fuji Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.742)	(0,00)
(1.900)	Fuji Kyuko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.377)	(0,00)
(21.800)	Fuji Media Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.620)	(0,00)
(100)	Fuji Seal International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38)	(0,00)
(5.500)	Fujitec Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.737)	(0,00)
(500)	Fujitsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.016)	(0,00)
(1.300)	Fukuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42)	(0,00)
(3.600)	Fuso Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.504)	(0,00)
(8.200)	Future Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.219)	(0,00)
(309.681)	Future Plc	JPMorgan Chase Bank	(21.075)	(0,00)
(232.640)	Future Plc	Goldman Sachs International	(48.542)	(0,00)
(116.790)	Future Plc	Morgan Stanley	(25.946)	(0,00)
(100)	Fuyo General Lease Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(0,00)
(3.517)	Gamma Communications Plc	Bank of America Merrill Lynch	(414)	(0,00)
(296.106)	Gaztransport Et Technigaz SA	Morgan Stanley	(4.101)	(0,00)
19.552	GB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.941)	(0,00)
394.000	Geberit AG	Goldman Sachs International	(24.749)	(0,00)
101.900	Geberit AG	JPMorgan Chase Bank	(4.717)	(0,00)
394.681	General Mills Inc	Morgan Stanley	(2.005)	(0,00)
63.100	General Motors Co	Morgan Stanley	(428.449)	(0,02)
43.774	Genesis Energy LP	Morgan Stanley	(5.555)	(0,00)
287	Genus Plc	Bank of America Merrill Lynch	(345)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(100)	Geo Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(211)	(0,00)
(75.489)	Getinge AB Class B	Morgan Stanley	(4.686)	(0,00)
(190.301)	Global Payments Inc	Morgan Stanley	(2.117)	(0,00)
(107.971)	Global Payments Inc	JPMorgan Chase Bank	(13.682)	(0,00)
(1.800)	Goldwin Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.854)	(0,00)
(77.131)	Grainger Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6.016)	(0,00)
28.900	Gree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.022)	(0,00)
(8.964)	Greggs Plc	Bank of America Merrill Lynch	(14.973)	(0,00)
(344.943)	Grid Dynamics Holdings Inc	Morgan Stanley	(16.329)	(0,00)
376.104	Growthpoint Properties Ltd	JPMorgan Chase Bank	(5.854)	(0,00)
3.472.765	Growthpoint Properties Ltd	Goldman Sachs International	(30.920)	(0,00)
60.164	GSK Plc	Bank of America Merrill Lynch	(191.704)	(0,01)
(3.700)	GungHo Online Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.564)	(0,00)
(52.700)	Gunma Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(35.596)	(0,00)
2.332.909	H & M Hennes & Mauritz AB Class B	Goldman Sachs International	(586)	(0,00)
(19.200)	Hakuhodo DY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24.764)	(0,00)
(3.800)	Hakuto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.690)	(0,00)
(58.558)	Haleon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.822)	(0,00)
14.902	Halma Plc	Bank of America Merrill Lynch	(38.291)	(0,00)
1.890.209	Hanesbrands Inc	JPMorgan Chase Bank	(188.544)	(0,01)
8.500	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.093)	(0,00)
(872.595)	Hanwha Solutions Corp	Morgan Stanley	(60.862)	(0,00)
3.086.112	Harley-Davidson Inc	JPMorgan Chase Bank	(283.282)	(0,02)
5.239.709	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	(364.959)	(0,01)
232.011	Harmony Biosciences Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(47.200)	(0,00)
1.383.064	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs International	(20.587)	(0,00)
120.700	Healthcare Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(32.580)	(0,00)
(1.750.827)	Healthcare Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	(20.840)	(0,00)
(5.566)	Healthpeak Properties Inc	Morgan Stanley	(30)	(0,00)
(3.900)	Heiwa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.641)	(0,00)
259.164	Henkel AG & Co KGaA	Morgan Stanley	(8.760)	(0,00)
21.464	Henkel AG & Co KGaA – Preferred Shares	Morgan Stanley	(6.161)	(0,00)
(4.191.526)	Hershey Co	Goldman Sachs International	(13.828)	(0,00)
(765.094)	Hershey Co	Morgan Stanley	(29.115)	(0,00)
(930.243)	Hess Corp	JPMorgan Chase Bank	(31.248)	(0,00)
(1.094.172)	Hess Corp	Morgan Stanley	(15.490)	(0,00)
113.540	Hewlett Packard Enterprise Co	JPMorgan Chase Bank	(29.717)	(0,00)
70.899	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	(729)	(0,00)
45.700	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.618)	(0,00)
100	Hirose Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(226)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(2.400)	HIS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(54)	(0,00)
(2.000)	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.270)	(0,00)
(28.041)	Hiscox Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(74.882)	(0,00)
3.400	Hitachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.612)	(0,00)
300	Hitachi Transport System Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3)	(0,00)
(10.700)	Hokkaido Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.855)	(0,00)
(32.300)	Hokuriku Electric Power Co	Bank of America Merrill Lynch	(31.595)	(0,00)
60.302	Holcim AG	Goldman Sachs International	(1.113)	(0,00)
999.235	Home Depot Inc	Morgan Stanley	(5.799)	(0,00)
1.494.751	Home Depot Inc	JPMorgan Chase Bank	(12.799)	(0,00)
501.604	Home Depot Inc	Goldman Sachs International	(913)	(0,00)
488.195	Home Reit Plc	Bank of America Merrill Lynch	(104.647)	(0,01)
(24.354)	HomeServe Plc	Bank of America Merrill Lynch	(8.316)	(0,00)
(362.357)	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	(6.848)	(0,00)
(2.800)	Hoshizaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.864)	(0,00)
333.721	Host Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	(73)	(0,00)
(995.678)	Hostess Brands Inc	Morgan Stanley	(106.004)	(0,01)
(283.098)	Hostess Brands Inc	Goldman Sachs International	(9.353)	(0,00)
(34.318)	Hostess Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	(100)	(0,00)
401.022	Howden Joinery Group Plc	Goldman Sachs International	(25.753)	(0,00)
100	Hoya Corp	Bank of America Merrill Lynch	(932)	(0,00)
157.225	HP Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.930)	(0,00)
236.832	HSBC Holdings Plc	Goldman Sachs International	(30.865)	(0,00)
129.747	HSBC Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	(11.325)	(0,00)
(114.292)	HubSpot Inc	Morgan Stanley	(2.498)	(0,00)
477.869	Humana Inc	Goldman Sachs International	(11.340)	(0,00)
1.253.555	Humana Inc	Morgan Stanley	(29.532)	(0,00)
2.004.323	Husqvarna AB Class B	Goldman Sachs International	(14.571)	(0,00)
4.139.968	Husqvarna AB Class B	Morgan Stanley	(80.050)	(0,00)
(1.162.995)	Hyatt Hotels Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(20.897)	(0,00)
(1.421.355)	Hyatt Hotels Corp Class A	Morgan Stanley	(101.609)	(0,00)
(5.954.853)	Hyatt Hotels Corp Class A	Goldman Sachs International	(143.376)	(0,01)
266.290	Iberdrola SA	Morgan Stanley	(7.040)	(0,00)
(600)	Ibiden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(26)	(0,00)
84.068	Ibstock Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.086)	(0,00)
(1.000)	Ichibanya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.320)	(0,00)
19.400	Ichigo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.201)	(0,00)
(441.375)	ICON Plc	JPMorgan Chase Bank	(9.461)	(0,00)
6.740	ICON Plc	Goldman Sachs International	(217)	(0,00)
(493.696)	ICON Plc	Morgan Stanley	(329)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
16.821	IG Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.609)	(0,00)
(8.200)	IHI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.548)	(0,00)
(11.100)	Iino Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.289)	(0,00)
320.273	Illumina Inc	Goldman Sachs International	(843)	(0,00)
262.657	Immunovant Inc	Goldman Sachs International	(4.673)	(0,00)
781.394	Imperial Oil Ltd	JPMorgan Chase Bank	(6.364)	(0,00)
661.515	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	(24.222)	(0,00)
299.111	Incyte Corp	Morgan Stanley	(9.285)	(0,00)
(698.038)	Independence Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	(30.554)	(0,00)
(9.960)	Indivior Plc	Bank of America Merrill Lynch	(60.621)	(0,00)
(1.015.649)	Infineon Technologies AG	Morgan Stanley	(113.496)	(0,01)
21.100	Infomart Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11.624)	(0,00)
3.900	Information Services International-Dentsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.118)	(0,00)
(26.328)	INFRONEER Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19.656)	(0,00)
9.320.000	ING Groep NV	Société Générale	(568.870)	(0,02)
(1.275.199)	Insmed Inc	JPMorgan Chase Bank	(146.553)	(0,01)
(405.766)	Insmed Inc	Morgan Stanley	(21.080)	(0,00)
(700)	Insource Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(307)	(0,00)
706.747	Insulet Corp	Goldman Sachs International	(2.083)	(0,00)
(16.271)	IntegraFin Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.160)	(0,00)
159.252	Intel Corp	JPMorgan Chase Bank	(3.093)	(0,00)
246.011	Intel Corp	Goldman Sachs International	(761)	(0,00)
(100.632)	Interactive Brokers Group Inc Class A	Morgan Stanley	(1.669)	(0,00)
(866.452)	Interactive Brokers Group Inc Class A	Goldman Sachs International	(29.945)	(0,00)
105.015	Intercontinental Exchange Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.109)	(0,00)
(493.572)	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs International	(7.160)	(0,00)
(328.646)	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	(4.370)	(0,00)
2.702.913	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	(85.094)	(0,00)
25.242	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	(78)	(0,00)
83.010	International Consolidated Airlines Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(7.187)	(0,00)
61.048	International Consolidated Airlines Group SA	Goldman Sachs International	(90.302)	(0,01)
134.046	International Consolidated Airlines Group SA	Morgan Stanley	(33.580)	(0,00)
(6.000)	Internet Initiative Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.955)	(0,00)
207.921	Interpublic Group of Cos Inc	Morgan Stanley	(3.936)	(0,00)
107.058	Interpublic Group of Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(728)	(0,00)
11.104	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	(366)	(0,00)
139.445	Intertek Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(17.167)	(0,00)
321.959	Intra-Cellular Therapies Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.499)	(0,00)
(165.565)	Intuit Inc	JPMorgan Chase Bank	(184)	(0,00)
5.300	Intuit Inc	Morgan Stanley	(95.558)	(0,00)



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(1.495.741)	Intuitive Surgical Inc	JPMorgan Chase Bank	(43.666)	(0,00)
174.191	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs International	(545)	(0,00)
(616.402)	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	(16.856)	(0,00)
(600.461)	Invesco Ltd	Morgan Stanley	(31.024)	(0,00)
(653.846)	Invesco Ltd	JPMorgan Chase Bank	(36.293)	(0,00)
38.162	IP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.315)	(0,00)
(4.584.695)	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs International	(133.164)	(0,01)
(1.230.816)	IQVIA Holdings Inc	Morgan Stanley	(59.468)	(0,00)
(929.374)	IQVIA Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(18.393)	(0,00)
(357.220)	iRobot Corp	Morgan Stanley	(69.020)	(0,00)
(41.300)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(42.574)	(0,00)
(7.335.432)	iShares EURO STOXX Banks 30-15 UCITS ETF	Morgan Stanley	(52.343)	(0,00)
3.700	Ito En Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.291)	(0,00)
(8.500)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.032)	(0,00)
(104.697)	IVERIC bio Inc	Morgan Stanley	(7.198)	(0,00)
(190.628)	IVERIC bio Inc	Goldman Sachs International	(1.692)	(0,00)
(1.200)	Iwatani Corp	Bank of America Merrill Lynch	(378)	(0,00)
(78.213)	IWG Plc	Bank of America Merrill Lynch	(20.050)	(0,00)
(2.300)	J Front Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(0,00)
(167.434)	Jabil Inc	Goldman Sachs International	(9.917)	(0,00)
(995.534)	Jabil Inc	JPMorgan Chase Bank	(39.346)	(0,00)
(619.830)	Jabil Inc	Morgan Stanley	(25.177)	(0,00)
(4.500)	Jaccs Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13.313)	(0,00)
(3.300)	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(449)	(0,00)
(2.100)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.255)	(0,00)
216.800	Japan Display Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24.383)	(0,00)
(1.900)	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(607)	(0,00)
(5.600)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.186)	(0,00)
(6.500)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.851)	(0,00)
4.800	Japan Steel Works Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.535)	(0,00)
261.291	JB Hi-Fi Ltd	JPMorgan Chase Bank	(12.671)	(0,00)
12.000	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.802)	(0,00)
(87.036)	JD Sports Fashion Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.712)	(0,00)
(1.102.637)	JD.com Inc	JPMorgan Chase Bank	(92)	(0,00)
10.900	Jeol Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(60.113)	(0,00)
1.594	JET2 Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.052)	(0,00)
(5.800)	JFE Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(214)	(0,00)
10.700	JGC Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.650)	(0,00)
(1.800)	JINS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.112)	(0,00)
3.600	JMDC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13.354)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
559.801	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	(874)	(0,00)
(942.267)	Johnson Controls International plc	JPMorgan Chase Bank	(40.170)	(0,00)
528.700	Johnson Matthey Plc	Goldman Sachs International	(6.220)	(0,00)
51.965	Johnson Matthey Plc	Morgan Stanley	(577)	(0,00)
937.946	Johnson Matthey Plc	JPMorgan Chase Bank	(14.552)	(0,00)
4.000	JTEKT Corp	Bank of America Merrill Lynch	(496)	(0,00)
1.800	Justsystems Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.316)	(0,00)
(168.997)	K+S AG	Morgan Stanley	(7.480)	(0,00)
(5.000)	Kagome Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.161)	(0,00)
5.454	Kainos Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.358)	(0,00)
(3.300)	Kajima Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.594)	(0,00)
(2.400)	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.783)	(0,00)
(5.200)	Kanamoto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.076)	(0,00)
(18.000)	Kansai Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.725)	(0,00)
11.200	Kansai Paint Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.055)	(0,00)
(6.000)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.372)	(0,00)
(1.400)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(143)	(0,00)
63.510	KBC Group NV	Goldman Sachs International	(13.777)	(0,00)
230.765	KBC Group NV	JPMorgan Chase Bank	(16.571)	(0,00)
110.152	KBC Group NV	Morgan Stanley	(19.613)	(0,00)
349.312	Kellogg Co	JPMorgan Chase Bank	(11.722)	(0,00)
4.691.942	Kellogg Co	Morgan Stanley	(11.047)	(0,00)
5.782	Kering SA	Goldman Sachs International	(410)	(0,00)
(4.172.378)	Keurig Dr Pepper Inc	Morgan Stanley	(93.208)	(0,01)
(1.034.125)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs International	(58.723)	(0,00)
1.600	Kewpie Corp	Bank of America Merrill Lynch	(412)	(0,00)
(200)	Keyence Corp	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(0,00)
14.758	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	(3.968)	(0,00)
281.657	Keysight Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(17.156)	(0,00)
19	Keywords Studios Plc	Bank of America Merrill Lynch	(21)	(0,00)
(2.700)	KH Neochem Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(590)	(0,00)
1.900	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.810)	(0,00)
118.047	Kimberly-Clark Corp	JPMorgan Chase Bank	(10.908)	(0,00)
784.796	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs International	(75.448)	(0,00)
1.154.616	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	(125.913)	(0,01)
(1.400)	Kinden Corp	Bank of America Merrill Lynch	(203)	(0,00)
235.478	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	(5.094)	(0,00)
2.647.648	Kinder Morgan Inc	JPMorgan Chase Bank	(113.778)	(0,01)
111.570	Kingfisher Plc	Morgan Stanley	(16.036)	(0,00)
(88.806)	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs International	(51)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(427.475)	Kingspan Group Plc	Morgan Stanley	(89.628)	(0,01)
9.200	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.800)	(0,00)
13.500	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.534)	(0,00)
(1.500)	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.951)	(0,00)
(800)	Ki-Star Real Estate Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.532)	(0,00)
(153.302)	KLA Corp	Morgan Stanley	(4.770)	(0,00)
4.400	Koa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.983)	(0,00)
(4.800)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.690)	(0,00)
(5.500)	Kobe Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(120)	(0,00)
(2.400)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.892)	(0,00)
(2.300)	Kohnan Shoji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.060)	(0,00)
(1.300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(336)	(0,00)
(9.400)	Kokuyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.532)	(0,00)
(5.200)	KOMEDA Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.612)	(0,00)
(4.000)	Komeri Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.753)	(0,00)
(197.559)	Kone OYJ Class B	Morgan Stanley	(13.595)	(0,00)
(311.496)	Konecranes OYJ	Morgan Stanley	(13.353)	(0,00)
(107.053)	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	(6.045)	(0,00)
543.483	Kraft Heinz Co	JPMorgan Chase Bank	(26.911)	(0,00)
1.140.998	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs International	(88.463)	(0,00)
3.629.580	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	(223.640)	(0,01)
30.079	Kroger Co	Morgan Stanley	(7.589)	(0,00)
3.400	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.263)	(0,00)
202.321	Kuehne + Nagel International AG	JPMorgan Chase Bank	(4.029)	(0,00)
369.731	Kuehne + Nagel International AG	Morgan Stanley	(7.171)	(0,00)
(6.200)	Kumagai Gumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.849)	(0,00)
4.900	Kura Sushi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.290)	(0,00)
3.800	Kureha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14.441)	(0,00)
800	Kurita Water Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.041)	(0,00)
(2.100)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(845)	(0,00)
(200)	KYB Corp	Bank of America Merrill Lynch	(99)	(0,00)
(500)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(585)	(0,00)
1.070.000.000	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Goldman Sachs International	(21.693)	(0,00)
3.800	Kyowa Kirin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(370)	(0,00)
(900)	Kyudenko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(507)	(0,00)
(57.900)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.754)	(0,00)
(500)	Kyushu Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(75)	(0,00)
(1.482.332)	Laboratory Corp of America Holdings	Goldman Sachs International	(2.060)	(0,00)
684.659	Laboratory Corp of America Holdings	Morgan Stanley	(25.346)	(0,00)
2.051.116	Laboratory Corp of America Holdings	JPMorgan Chase Bank	(15.357)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
120.443	Lam Research Corp	JPMorgan Chase Bank	(23.377)	(0,00)
(126.799)	Lamar Advertising Co Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.176)	(0,00)
(17.662)	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.452)	(0,00)
(220.775)	Lantheus Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(61.302)	(0,00)
(852.466)	Lantheus Holdings Inc	Goldman Sachs International	(55.104)	(0,00)
(41.147.663)	Lasertec Corp	JPMorgan Chase Bank	(48.181)	(0,00)
(60.552.962)	Lasertec Corp	Morgan Stanley	(13.977)	(0,00)
(1.284.052)	Lattice Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(77.232)	(0,00)
(54.968)	Lattice Semiconductor Corp	Goldman Sachs International	(3.864)	(0,00)
(160.928)	Lattice Semiconductor Corp	JPMorgan Chase Bank	(10.938)	(0,00)
1.186.574	Lazard Ltd Class A	JPMorgan Chase Bank	(17.128)	(0,00)
169.479	Legal & General Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(8.301)	(0,00)
(273.599)	Legrand SA	Goldman Sachs International	(24.731)	(0,00)
2.472.284	Levi Strauss & Co Class A	JPMorgan Chase Bank	(30.470)	(0,00)
(628.492)	LHC Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(18.191)	(0,00)
151.866	Li Auto Inc	Goldman Sachs International	(1.180)	(0,00)
1.933.359	Li Auto Inc	Morgan Stanley	(210.554)	(0,01)
14.191	Liberty Global Plc Class A	Goldman Sachs International	(404)	(0,00)
(611.148)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One Class C	JPMorgan Chase Bank	(33.929)	(0,00)
(4.000)	Life Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.537)	(0,00)
(1.056.439)	Life Storage Inc	Goldman Sachs International	(15.529)	(0,00)
(257.836)	Life Time Group Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(110.950)	(0,01)
(184.703)	Life Time Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(26.408)	(0,00)
7.900	Link And Motivation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(687)	(0,00)
(2.600)	Lintec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(344)	(0,00)
(3.402.944)	Lithia Motors Inc Class A	Morgan Stanley	(93.188)	(0,01)
3.400	Lixil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(290)	(0,00)
6.500.000	Lloyds Banking Group Plc	Société Générale	(684.570)	(0,02)
(905.316)	Lloyds Banking Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11.129)	(0,00)
71.304	Logitech International SA	Goldman Sachs International	(4.279)	(0,00)
17.076	Logitech International SA	JPMorgan Chase Bank	(381)	(0,00)
(861.445)	Longshine Technology Group Co Ltd	Morgan Stanley	(313.102)	(0,01)
(5.115)	L'Oreal SA	Goldman Sachs International	(5.077)	(0,00)
207.746	Lucid Group Inc	Morgan Stanley	(5.818)	(0,00)
(2.259.144)	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	(111.952)	(0,00)
(6.865.835)	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs International	(184.405)	(0,01)
4.404	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Goldman Sachs International	(464)	(0,00)
200.005	LXI REIT Plc	Bank of America Merrill Lynch	(26.094)	(0,00)
30.393	Lyft Inc Class A	Morgan Stanley	(1.591)	(0,00)
(180.819)	M&G Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.998)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
2.400	M3 Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.844)	(0,00)
2.700	Mabuchi Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.044)	(0,00)
(1.065.531)	Macy's Inc	JPMorgan Chase Bank	(124.689)	(0,01)
(1.600)	Mani Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.347)	(0,00)
(922.367)	Marathon Petroleum Corp	JPMorgan Chase Bank	(1.555)	(0,00)
370.993	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs International	(15.333)	(0,00)
(73.190)	Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	(33.659)	(0,00)
367.894	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs International	(75.618)	(0,00)
1.707.980	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	(145.824)	(0,01)
13.000.000	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs International	(17.484)	(0,00)
16.328	Marshalls Plc	Bank of America Merrill Lynch	(793)	(0,00)
(1.119.315)	Martin Marietta Materials Inc	Morgan Stanley	(40.000)	(0,00)
(42.999)	Martin Marietta Materials Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.226)	(0,00)
(16.500)	Marubeni Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.961)	(0,00)
(2.800)	Maruichi Steel Tube Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(329)	(0,00)
1.000	Maruwa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.228)	(0,00)
177.143	Mastercard Inc Class A	Goldman Sachs International	(4.197)	(0,00)
185.363	Mastercard Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(3.604)	(0,00)
(18.400)	Matsui Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.291)	(0,00)
(2.960)	MatsukiyoCocokara & Co	Bank of America Merrill Lynch	(11.598)	(0,00)
725.858	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs International	(58.321)	(0,00)
465.667	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	(57.119)	(0,00)
(300)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(176)	(0,00)
(852.776)	McKesson Corp	JPMorgan Chase Bank	(5.020)	(0,00)
(1.769.790)	McKesson Corp	Goldman Sachs International	(11.426)	(0,00)
(356.324)	McKesson Corp	Morgan Stanley	(4.277)	(0,00)
(249.172)	MediaAlpha Inc Class A	Morgan Stanley	(6.108)	(0,00)
(1.604.936)	MediaTek Inc	Morgan Stanley	(58.153)	(0,00)
(2.517.953)	MediaTek Inc	JPMorgan Chase Bank	(449.130)	(0,02)
15.200	Medical Data Vision Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22.829)	(0,00)
32.026	Mediclinic International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.459)	(0,00)
(3.100)	Medley Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.369)	(0,00)
2.800.608	Medtronic Plc	Morgan Stanley	(28.902)	(0,00)
1.616.778	Medtronic Plc	Goldman Sachs International	(402)	(0,00)
(2.800)	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.513)	(0,00)
4.500	Meidensha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.020)	(0,00)
(2.500)	MEIJI Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.870)	(0,00)
(500)	Meitec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(107)	(0,00)
27.900.000	Meituan	Société Générale	(111.461)	(0,01)
11.325.478	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs International	(154.730)	(0,01)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(1.600)	Mercari Inc	Bank of America Merrill Lynch	(204)	(0,00)
95.836	Mercedes-Benz Group AG	Morgan Stanley	(31.596)	(0,00)
(878.454)	Merck & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.053)	(0,00)
(13.178)	Meridian Bioscience Inc	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
(164.975)	Merus NV	Morgan Stanley	(8.323)	(0,00)
(55.586)	Merus NV	JPMorgan Chase Bank	(1.164)	(0,00)
(560.024)	Merus NV	Goldman Sachs International	(52.836)	(0,00)
457.410	Mettler-Toledo International Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.370)	(0,00)
117.360	Microchip Technology Inc	JPMorgan Chase Bank	(18.577)	(0,00)
223.616	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(12.665)	(0,00)
(7.400)	MIRAIT ONE corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.179)	(0,00)
5.400	Mitsubishi Estate Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(217)	(0,00)
3.900	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(409)	(0,00)
1.900	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.621)	(0,00)
1.500	Mitsubishi Logistics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(600)	(0,00)
(73.400)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45.753)	(0,00)
(6.200)	Mitsuboshi Belting Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10.787)	(0,00)
(4.600)	Mitsui & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14.761)	(0,00)
(200)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(0,00)
4.600	Mitsui High-Tec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22.910)	(0,00)
(1.300)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(229)	(0,00)
2.500	Mitsui OSK Lines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(957)	(0,00)
(1.100)	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.289)	(0,00)
(3.100)	Mixi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.324)	(0,00)
(2.700)	Mizuho Leasing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.465)	(0,00)
118.561	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	(1.843)	(0,00)
164.260	MKS Instruments Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.865)	(0,00)
(285.297)	Moderna Inc	JPMorgan Chase Bank	(220)	(0,00)
(263.865)	Moelis & Co Class A	Goldman Sachs International	(25.295)	(0,00)
(1.280.657)	Moelis & Co Class A	Morgan Stanley	(158.660)	(0,01)
125.064.140	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	Morgan Stanley	(1.773)	(0,00)
549.215	Molson Coors Beverage Co Class B	Morgan Stanley	(33.129)	(0,00)
79.082	Molson Coors Beverage Co Class B	JPMorgan Chase Bank	(1.548)	(0,00)
196.499	Mondelez International Inc Class A	Goldman Sachs International	(13.056)	(0,00)
14.700	Monex Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(192)	(0,00)
(600)	Money Forward Inc	Bank of America Merrill Lynch	(649)	(0,00)
336.912	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs International	(30.155)	(0,00)
9.700	MonotaRO Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.189)	(0,00)
544.650	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	(29.779)	(0,00)
222.587	Montauk Renewables Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.757)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(5.300)	Morinaga & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.903)	(0,00)
(6.400)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28.269)	(0,00)
(95.260)	Morphic Holding Inc	JPMorgan Chase Bank	(13.092)	(0,00)
(120.277)	Morphic Holding Inc	Morgan Stanley	(33.577)	(0,00)
(313.310)	MorphoSys AG	Goldman Sachs International	(125.855)	(0,01)
(233.392)	MorphoSys AG	JPMorgan Chase Bank	(55.688)	(0,00)
(71.423)	MorphoSys AG	Morgan Stanley	(16.720)	(0,00)
(2.100)	MOS Food Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(504)	(0,00)
(246.014)	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	(342)	(0,00)
(780.437)	Motorola Solutions Inc	JPMorgan Chase Bank	(15.442)	(0,00)
(8.500)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18.980)	(0,00)
(468.744)	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	(5.532)	(0,00)
(89.772)	Murphy USA Inc	JPMorgan Chase Bank	(918)	(0,00)
(200)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(0,00)
(4.400)	Nabtesco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.291)	(0,00)
(8.600)	Nagoya Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.489)	(0,00)
(1.800)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.382)	(0,00)
86.067	National Express Group Plc	Goldman Sachs International	(309)	(0,00)
(407.811)	National Instruments Corp	Morgan Stanley	(6.736)	(0,00)
(428.545)	National Instruments Corp	JPMorgan Chase Bank	(27.470)	(0,00)
1.021.446	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	(129.479)	(0,01)
(390.481)	NatWest Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(63.816)	(0,00)
5.800.000	NatWest Group Plc	Société Générale	(567.442)	(0,02)
(900)	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(99)	(0,00)
(6.600)	NEC Networks & System Integration Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.976)	(0,00)
(9.581.207)	Nedbank Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(13.370)	(0,00)
(4.378.971)	Nedbank Group Ltd	Morgan Stanley	(9.415)	(0,00)
(5.545.560)	Nedbank Group Ltd	Goldman Sachs International	(10.842)	(0,00)
(141.566)	Nektar Therapeutics	JPMorgan Chase Bank	(51.203)	(0,00)
(34.078)	NeoGenomics Inc	Goldman Sachs International	(3.492)	(0,00)
(862.709)	Neste Oil Oyj	Morgan Stanley	(25.363)	(0,00)
(1.200)	NET One Systems Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.108)	(0,00)
722.662	NetEase Inc	JPMorgan Chase Bank	(89.623)	(0,00)
439.496	NetEase Inc	Morgan Stanley	(34.551)	(0,00)
547.435	NetEase Inc	Goldman Sachs International	(54.973)	(0,00)
(1.492.392)	Netflix Inc	Morgan Stanley	(57.082)	(0,00)
(1.416.817)	Netflix Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.720)	(0,00)
(4.933.045)	Netflix Inc	Goldman Sachs International	(34.065)	(0,00)
(284.297)	Network International Holdings Plc	Goldman Sachs International	(19.619)	(0,00)
(10.500)	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	(4)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(1.100)	New York Times Co Class A	Morgan Stanley	(101)	(0,00)
33.800.000	Nexi SpA	Société Générale	(145.322)	(0,01)
(8.500)	Nexon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.942)	(0,00)
3.868	Next Fifteen Communications Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.968)	(0,00)
(82.874)	NextEra Energy Inc	Morgan Stanley	(522)	(0,00)
(168.073)	NextEra Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.286)	(0,00)
(900)	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(96)	(0,00)
4.900	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.481)	(0,00)
(4.500)	Nichias Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.231)	(0,00)
9.500	Nichicon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.170)	(0,00)
(5.800)	Nichirei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.937)	(0,00)
35.160	Nick Scali Ltd	Goldman Sachs International	(11.478)	(0,00)
2.884	Nick Scali Ltd	JPMorgan Chase Bank	(692)	(0,00)
3.100	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11.280)	(0,00)
5.500	Nihon M&A Center Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.419)	(0,00)
(800)	Nikkon Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(228)	(0,00)
20.400	Nikon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.828)	(0,00)
10.222	Ninety One Plc	Bank of America Merrill Lynch	(519)	(0,00)
(106.282.803)	Nintendo Co Ltd	Morgan Stanley	(67.734)	(0,00)
(31.899.738)	Nintendo Co Ltd	Goldman Sachs International	(11.211)	(0,00)
(67.698.034)	Nintendo Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.720)	(0,00)
(700)	Nippon Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(41)	(0,00)
(700)	Nippon Parking Development Co Ltd Class C	Bank of America Merrill Lynch	(358)	(0,00)
14.500	Nippon Sanso Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.525)	(0,00)
2.600	Nippon Shinyaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(633)	(0,00)
(800)	Nippon Shokubai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(322)	(0,00)
(1.200)	Nippon Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(309)	(0,00)
(1.400)	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Bank of America Merrill Lynch	(270)	(0,00)
(8.800)	Nippon Yusen KK	Bank of America Merrill Lynch	(8.161)	(0,00)
(7.500)	Nipro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(657)	(0,00)
(4.800)	Nishimatsu Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.709)	(0,00)
(2.600)	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(857)	(0,00)
(26.000)	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25.818)	(0,00)
6.200	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.807)	(0,00)
(296.581)	NiSource Inc	Goldman Sachs International	(1.417)	(0,00)
930.899	Nissan Motor Co Ltd	Goldman Sachs International	(9.245)	(0,00)
(6.100)	Nissha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(958)	(0,00)
100	Nissin Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(72)	(0,00)
(1.600)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.859)	(0,00)
(1.600)	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(48.907)	(0,00)



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
2.987	NMC Health Plc	Morgan Stanley	(418)	(0,00)
(353.989)	Noble Corp Plc	Morgan Stanley	(2.454)	(0,00)
(6.100)	Noble Corp	Morgan Stanley	(12.204)	(0,00)
6.100	Nomura Real Estate Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.897)	(0,00)
(1.300)	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(89)	(0,00)
(1.274.271)	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs International	(62.387)	(0,00)
(2.221.693)	Norfolk Southern Corp	JPMorgan Chase Bank	(84.085)	(0,00)
1.221.426	Northern Trust Corp	Goldman Sachs International	(60.653)	(0,00)
127.435	Northern Trust Corp	JPMorgan Chase Bank	(14.824)	(0,00)
750.585	Novartis AG	JPMorgan Chase Bank	(80.841)	(0,00)
217.870	Novartis AG	Morgan Stanley	(31.532)	(0,00)
1.054.058	Novo Nordisk A/S	Morgan Stanley	(17.975)	(0,00)
638.610	Novo Nordisk A/S	JPMorgan Chase Bank	(4.610)	(0,00)
427.205	Novo Nordisk A/S	Goldman Sachs International	(1.609)	(0,00)
(87.202)	Novozymes A/S Class B	Morgan Stanley	(6.720)	(0,00)
(406.386)	NRG Energy Inc	Morgan Stanley	(579)	(0,00)
500	NSD Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(200)	(0,00)
(2.100)	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(0,00)
354.820	Nu Skin Enterprises Inc	Morgan Stanley	(39.328)	(0,00)
61.374	Nu Skin Enterprises Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(4.318)	(0,00)
298.079	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Goldman Sachs International	(30.377)	(0,00)
(454.279)	Nurix Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.425)	(0,00)
43.936	NuStar Energy LP	Morgan Stanley	(2.984)	(0,00)
185.252	NuStar Energy LP	Goldman Sachs International	(2.503)	(0,00)
(289.224)	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	(5.620)	(0,00)
45.591	NVIDIA Corp	JPMorgan Chase Bank	(10.288)	(0,00)
142.529	NVIDIA Corp	Goldman Sachs International	(724)	(0,00)
1.438.375	NXP Semiconductors NV	Goldman Sachs International	(103.031)	(0,01)
1.531.932	NXP Semiconductors NV	JPMorgan Chase Bank	(53.129)	(0,00)
415.403	Oak Street Health Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.225)	(0,00)
130.018	Oak Street Health Inc	Goldman Sachs International	(917)	(0,00)
5.100	Obayashi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(59)	(0,00)
(2.600)	OBIC Business Consultants Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(983)	(0,00)
600	Obic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.120)	(0,00)
397	OCI NV	Morgan Stanley	(906)	(0,00)
(11.900)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(862)	(0,00)
(29.700)	Oji Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.985)	(0,00)
2.900	OKUMA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(186)	(0,00)
(3.600)	Okumura Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.930)	(0,00)
(218.365)	Olaplex Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(36.564)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)**

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(154.717)	Olaplex Holdings Inc	Morgan Stanley	(42.150)	(0,00)
(977.711)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(80.209)	(0,00)
4.000	Olympus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.576)	(0,00)
153.739	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	(5.306)	(0,00)
291.766	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	(11.419)	(0,00)
54.591	Omnicom Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.775)	(0,00)
(1.000)	Omron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(342)	(0,00)
(683.957)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(24.782)	(0,00)
(576.122)	ON Semiconductor Corp	JPMorgan Chase Bank	(50.366)	(0,00)
3.500	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.886)	(0,00)
1.600	Open House Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(587)	(0,00)
3.100	Optex Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(836)	(0,00)
452.815	Option Care Health Inc	Goldman Sachs International	(9.396)	(0,00)
(314.140)	Oracle Corp	Goldman Sachs International	(1.353)	(0,00)
(1.200)	Oracle Corp Japan	Bank of America Merrill Lynch	(3.628)	(0,00)
(97.500)	Orchid Island Capital Inc	Morgan Stanley	(31.589)	(0,00)
(3.200)	Organo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11.922)	(0,00)
(358.279)	Origin Materials Inc	Morgan Stanley	(84.057)	(0,00)
9.100.000	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs International	(19.867)	(0,00)
(700)	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(598)	(0,00)
400	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(542)	(0,00)
690.707	Oshkosh Corp	Goldman Sachs International	(92.608)	(0,01)
(386.415.599)	OTP Bank Nyrt	JPMorgan Chase Bank	(68)	(0,00)
(104.846.191)	OTP Bank Nyrt	Goldman Sachs International	(3.301)	(0,00)
500	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(0,00)
2.700	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.735)	(0,00)
800	Otter Tail Corp	Morgan Stanley	(2.248)	(0,00)
6.600	Outsourcing Inc	Bank of America Merrill Lynch	(260)	(0,00)
(2.778)	Oxford Instruments Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.699)	(0,00)
(397.845)	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs International	(97.717)	(0,01)
(760.839)	Pacira BioSciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(76.036)	(0,00)
(214.145)	Pacira BioSciences Inc	Morgan Stanley	(4.281)	(0,00)
18.629	Pagegroup Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.646)	(0,00)
(1.100)	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(810)	(0,00)
(336.874)	Palo Alto Networks Inc	JPMorgan Chase Bank	(49.820)	(0,00)
(497.059)	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	(45.280)	(0,00)
(1.900)	PALTAC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.589)	(0,00)
(157.309.286)	Panasonic Holdings Corp	Goldman Sachs International	(96.566)	(0,01)
(176.783.871)	Panasonic Holdings Corp	Morgan Stanley	(155.029)	(0,01)
(127.999)	Panasonic Holdings Corp	JPMorgan Chase Bank	(129)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(456.452)	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	(20.956)	(0,00)
(3.085)	Paragon Banking Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(711)	(0,00)
206.184	Park Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	(14.536)	(0,00)
(7.700)	Park24 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12.552)	(0,00)
(951.874)	Parker-Hannifin Corp	JPMorgan Chase Bank	(7.344)	(0,00)
442.507	Patterson Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(21.598)	(0,00)
(535.808)	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs International	(15.751)	(0,00)
389.095	Paychex Inc	Morgan Stanley	(6.824)	(0,00)
(349.018)	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	(12.945)	(0,00)
(135.591)	PayPal Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(23.309)	(0,00)
47.028	Pearson Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.011)	(0,00)
3.415.459	Pentair Plc	JPMorgan Chase Bank	(21.139)	(0,00)
1.761.413	Pentair Plc	Goldman Sachs International	(36.533)	(0,00)
168.543	Penumbra Inc	Goldman Sachs International	(43.394)	(0,00)
578.171	Penumbra Inc	Morgan Stanley	(84.216)	(0,00)
(6.000)	PeptiDream Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.934)	(0,00)
681.071	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs International	(50.417)	(0,00)
13.576	Persimmon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7.021)	(0,00)
54.120	Petershill Partners Plc	Bank of America Merrill Lynch	(12.477)	(0,00)
394.450	Petropavlovsk Plc	Morgan Stanley	(5.694)	(0,00)
934.578	Pfizer Inc	Goldman Sachs International	(2.649)	(0,00)
61.919	Pfizer Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.463)	(0,00)
812.838	Pfizer Inc	Morgan Stanley	(48.175)	(0,00)
1.259.223	Phillips 66	JPMorgan Chase Bank	(56.903)	(0,00)
636.271	Phillips 66	Morgan Stanley	(21.792)	(0,00)
(757.506)	Phillips Edison & Co Inc	Goldman Sachs International	(25.117)	(0,00)
(6.200)	Pigeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(833)	(0,00)
7.600	Piolax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.738)	(0,00)
214.865	Pioneer Natural Resources Co	Goldman Sachs International	(10.024)	(0,00)
317.931	Plains GP Holdings LP Class A	Goldman Sachs International	(13.657)	(0,00)
(379.531)	Pliant Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(41.141)	(0,00)
(330.053)	Pliant Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(37.194)	(0,00)
(524.898)	Plug Power Inc	JPMorgan Chase Bank	(44.140)	(0,00)
(116.070)	Plug Power Inc	Morgan Stanley	(6.373)	(0,00)
(1.660.331)	Plug Power Inc	Goldman Sachs International	(679.953)	(0,02)
(125.888)	Point Biopharma Global Inc	JPMorgan Chase Bank	(24.242)	(0,00)
(5.200)	Pola Orbis Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.138)	(0,00)
4.134.725	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	Morgan Stanley	(170.292)	(0,01)
2.739.275	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	Goldman Sachs International	(30.105)	(0,00)
(21.600)	Poshmark Inc Class A	Morgan Stanley	(23)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
3.284.919	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	JPMorgan Chase Bank	(52.715)	(0,00)
216.398	Premier Inc Class A	Goldman Sachs International	(530)	(0,00)
321.059	Premier Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(4.333)	(0,00)
(1.400)	Pressance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.162)	(0,00)
46.967	ProSiebenSat.1 Media SE	JPMorgan Chase Bank	(2.574)	(0,00)
540.150	Prosus NV	Morgan Stanley	(246)	(0,00)
(12.069)	Prudential Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.120)	(0,00)
(907.141)	PTC Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(59.033)	(0,00)
(586.867)	PTC Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(28.128)	(0,00)
(1.159.726)	PTC Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(55.443)	(0,00)
(4.315.867)	Public Storage	Goldman Sachs International	(151.469)	(0,01)
65.358	Pure Storage Inc Class A	Morgan Stanley	(31.263)	(0,00)
558.813	PureCycle Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.078)	(0,00)
352.244	PureCycle Technologies Inc	Goldman Sachs International	(32.363)	(0,00)
466.988	PureCycle Technologies Inc	Morgan Stanley	(21.628)	(0,00)
(1.053.467)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	(18.573)	(0,00)
(4.179.841)	QUALCOMM Inc	JPMorgan Chase Bank	(489.934)	(0,02)
(1.337.027)	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	(121.911)	(0,01)
(267.241)	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs International	(61.671)	(0,00)
4.097.301	Quest Diagnostics Inc	Goldman Sachs International	(209.476)	(0,01)
1.289.255	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	(59.187)	(0,00)
247.778	Quest Diagnostics Inc	JPMorgan Chase Bank	(304)	(0,00)
(34.000)	Quidel Corp	Morgan Stanley	(8.239)	(0,00)
(102)	QuidelOrtho Corp	JPMorgan Chase Bank	(18)	(0,00)
124.336	Quilter Plc	Morgan Stanley	(27.110)	(0,00)
(127.627)	R1 RCM Inc	Goldman Sachs International	(29.799)	(0,00)
(1.065)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	(617)	(0,00)
(19.500)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	(2.258)	(0,00)
(1.800)	Raksul Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.016)	(0,00)
(2.350.391)	Ralph Lauren Corp	JPMorgan Chase Bank	(11.644)	(0,00)
69.370	Randstad NV	Morgan Stanley	(2.996)	(0,00)
(3.332)	Rathbones Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(944)	(0,00)
159.141	REA Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(3.100)	(0,00)
41.786	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs International	(10.253)	(0,00)
104.591	Recursion Pharmaceuticals Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(4.111)	(0,00)
217.817	Red Rock Resorts Inc Class A	Morgan Stanley	(2.628)	(0,00)
244.240	Redrow Plc	Goldman Sachs International	(1.537)	(0,00)
(535.559)	Relay Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(69.866)	(0,00)
(151.170)	Relay Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(43.149)	(0,00)
(40.110)	RELX Plc	Morgan Stanley	(422)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
134.540	Renault SA	JPMorgan Chase Bank	(4.959)	(0,00)
6.200	Renesas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.717)	(0,00)
(5.300)	Rengo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.222)	(0,00)
3.000	RENOVA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.924)	(0,00)
1.264.123	Repsol SA	JPMorgan Chase Bank	(68.323)	(0,00)
124.509	Repsol SA	Goldman Sachs International	(8.864)	(0,00)
(830.623)	ResMed Inc	JPMorgan Chase Bank	(37.315)	(0,00)
(701.212)	ResMed Inc	Goldman Sachs International	(40.053)	(0,00)
(552.037)	ResMed Inc	Morgan Stanley	(23.027)	(0,00)
(29.100)	Resona Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23.623)	(0,00)
(5.300)	Resorttrust Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.475)	(0,00)
(328.484)	REVOLUTION Medicines Inc	Goldman Sachs International	(11.377)	(0,00)
(4.672.723)	Rexford Industrial Realty Inc	Goldman Sachs International	(49.867)	(0,00)
314.473	Reynolds Consumer Products Inc	Goldman Sachs International	(18.594)	(0,00)
56.343	Reynolds Consumer Products Inc	Morgan Stanley	(8.427)	(0,00)
69.348	Rheinmetall AG	Morgan Stanley	(5.599)	(0,00)
(1.200)	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(117)	(0,00)
(264.922)	Rightmove Plc	Goldman Sachs International	(1.020)	(0,00)
17.318	Rightmove Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.571)	(0,00)
365.160	Rio Tinto Plc	Goldman Sachs International	(58.864)	(0,00)
300.918	Rio Tinto Plc	JPMorgan Chase Bank	(24.913)	(0,00)
301.087	RLJ Lodging Trust	Goldman Sachs International	(5.026)	(0,00)
126.989	ROBLOX Corp Class A	Morgan Stanley	(1.908)	(0,00)
(1.944.363)	Roche Holding AG	JPMorgan Chase Bank	(103.560)	(0,01)
(1.441.604)	Roche Holding AG	Morgan Stanley	(59.654)	(0,00)
(27.565)	Rocket Cos Inc Class A	Morgan Stanley	(1.243)	(0,00)
(148.698.298)	Rohm Co Ltd	Morgan Stanley	(137.565)	(0,01)
(69.136.701)	Rohm Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(76.220)	(0,00)
500	Rohm Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.394)	(0,00)
(75.565)	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldman Sachs International	(58.954)	(0,00)
(30.248)	Rolls-Royce Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	(6.130)	(0,00)
(900)	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	(22.126)	(0,00)
95.144	RS GROUP Plc	Goldman Sachs International	(8.762)	(0,00)
700	RS Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(83)	(0,00)
311.574	RWE AG	Morgan Stanley	(97.009)	(0,01)
1.375.060	Ryanair Holdings Plc	Morgan Stanley	(53.716)	(0,00)
(2.658.215)	Ryanair Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	(174.671)	(0,01)
(3.400)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.420)	(0,00)
(5.881)	S4 Capital Plc	Bank of America Merrill Lynch	(676)	(0,00)
882.673	Safran SA	Société Générale	(48.098)	(0,01)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
78.439	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(34.565)	(0,00)
(4.800)	Saizeriya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.316)	(0,00)
12.110	Salesforce Inc	Morgan Stanley	(203.509)	(0,01)
(520.930)	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	Morgan Stanley	(1.152)	(0,00)
(128.986)	Samsung Electronics Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(2.232)	(0,00)
(938.595)	Samsung Electronics Co Ltd	Morgan Stanley	(74.811)	(0,00)
(1.878.946)	Samsung Electronics Co Ltd - Preferred Shares	JPMorgan Chase Bank	(310.383)	(0,01)
(740.712)	Samsung Electronics Co Ltd - Preferred Shares	Morgan Stanley	(188.996)	(0,01)
6.900	SAMTY Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(0)	(0,00)
(2.251.223)	Sandvik AB	JPMorgan Chase Bank	(3.897)	(0,00)
(261.124)	Sandvik AB	Morgan Stanley	(1.136)	(0,00)
(115.086)	Sangamo Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(16.897)	(0,00)
(77.955)	Sangamo Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(12.805)	(0,00)
(3.600)	Sangetsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(496)	(0,00)
(8.500)	San-In Godo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(463)	(0,00)
(4.300)	Sanken Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46.337)	(0,00)
(3.300)	Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13.829)	(0,00)
(3.900)	Sankyu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.008)	(0,00)
(75.387)	Sanofi	JPMorgan Chase Bank	(37.190)	(0,00)
(828.482)	Sanofi	Morgan Stanley	(23.313)	(0,00)
893.793	Saputo Inc	Goldman Sachs International	(25.935)	(0,00)
12.832	Savills Plc	Bank of America Merrill Lynch	(963)	(0,00)
(47.939)	Schindler Holding AG	Goldman Sachs International	(535)	(0,00)
(307.776)	Schneider Electric SE	Goldman Sachs International	(8.477)	(0,00)
(316.369)	Schneider Electric SE	Morgan Stanley	(20.706)	(0,00)
(753.877)	Schneider Electric SE	JPMorgan Chase Bank	(4.098)	(0,00)
(1.500)	SCREEN Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(560)	(0,00)
50.231	Seagate Technology Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	(140)	(0,00)
143.833	Seagate Technology Holdings Plc	Morgan Stanley	(4.494)	(0,00)
12.304	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs International	(82)	(0,00)
1.363.296	SeaWorld Entertainment Inc	JPMorgan Chase Bank	(108.349)	(0,01)
(8.900)	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.539)	(0,00)
(24.400)	Seibu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.307)	(0,00)
(4.700)	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(171)	(0,00)
(800)	Sekisui Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(43)	(0,00)
(600)	Sekisui House Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(58)	(0,00)
27.500	Septeni Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.737)	(0,00)
149.685	Serco Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16.298)	(0,00)
(7.100)	Seria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16.691)	(0,00)
(538.260)	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	(7.700)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
5.000	SG Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.137)	(0,00)
(18.042)	Shell Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6.728)	(0,00)
(1.584.172)	Shell Plc	Morgan Stanley	(36.470)	(0,00)
(16.500)	Shift4 Payments Inc Class A	Morgan Stanley	(1.545)	(0,00)
(13.200)	Shikoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.443)	(0,00)
115.891.825	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(19.276)	(0,00)
2.100	Shinko Electric Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.663)	(0,00)
10.600	Shinsei Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.627)	(0,00)
(4.200)	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28.927)	(0,00)
2.300	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.104)	(0,00)
(500)	Shochiku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(546)	(0,00)
(185.767)	Shockwave Medical Inc	Goldman Sachs International	(6.119)	(0,00)
(661.918)	Shockwave Medical Inc	JPMorgan Chase Bank	(35.402)	(0,00)
(283.820)	Shopify Inc Class A	Morgan Stanley	(56.210)	(0,00)
(2.036.668)	Shoptite Holdings Ltd	Morgan Stanley	(12.037)	(0,00)
(30.979.530)	Shoptite Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(103.570)	(0,01)
(2.667.338)	Shoptite Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	(8.339)	(0,00)
2.700	Showa Denko KK	Bank of America Merrill Lynch	(2.109)	(0,00)
26.879	Siemens AG	Morgan Stanley	(24.703)	(0,00)
31.900	Siemens Healthineers AG	Morgan Stanley	(4.468)	(0,00)
(226.261)	Sierra Wireless Inc	Morgan Stanley	(12.838)	(0,00)
(438.831)	Signify Health Inc Class A	Morgan Stanley	(5.067)	(0,00)
(239.476)	Signify NV	Morgan Stanley	(17.150)	(0,00)
(705.587)	Sika AG	Morgan Stanley	(206.779)	(0,01)
(398.998)	Silicon Motion Technology Corp	JPMorgan Chase Bank	(99.652)	(0,01)
159.197	Sirius Real Estate Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.539)	(0,00)
539.824	Six Flags Entertainment Corp	Morgan Stanley	(21.566)	(0,00)
(82.665)	Skanska AB Class B	Morgan Stanley	(3.319)	(0,00)
10.817.635	SKF AB Class B	Goldman Sachs International	(835)	(0,00)
(752.613)	SKF AB Class B	Morgan Stanley	(16.394)	(0,00)
8.900	Skylark Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.325)	(0,00)
274.678	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	(7.790)	(0,00)
12.354	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs International	(264)	(0,00)
3.100	SLM Corp	Morgan Stanley	(2.201)	(0,00)
(12.379)	Smart Metering Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.588)	(0,00)
100	SMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.386)	(0,00)
(168.058)	Smith & Nephew Plc	Goldman Sachs International	(6.608)	(0,00)
(57.851)	Smith & Nephew Plc	Morgan Stanley	(1.023)	(0,00)
717.276	Smiths Group Plc	Goldman Sachs International	(94.915)	(0,01)
(28.313)	Smiths Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(18.634)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
3.071	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.170)	(0,00)
(156.600)	Snap Inc Class A	Morgan Stanley	(96.938)	(0,01)
(2.428.263)	Societe Generale SA	Morgan Stanley	(5.889)	(0,00)
(55.743.669)	Socionext Inc	Morgan Stanley	(57.690)	(0,00)
(299.537)	Sodexo SA	Morgan Stanley	(4.824)	(0,00)
(21.700)	Softbank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12.637)	(0,00)
129.759.577	SoftBank Group Corp	Goldman Sachs International	(51.544)	(0,00)
(4.480)	Sojitz Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.069)	(0,00)
(1.437.483)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs International	(171.502)	(0,00)
(1.337.270)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	(98.104)	(0,00)
(3.998.055)	SolarEdge Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(377.660)	(0,01)
1.164.442	Sonos Inc	Morgan Stanley	(52.338)	(0,00)
(505.284.731)	Sony Group Corp	Morgan Stanley	(696.381)	(0,02)
(219.908.894)	Sony Group Corp	JPMorgan Chase Bank	(122.920)	(0,01)
(8.100)	Sotetsu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.232)	(0,00)
145.311	Sovos Brands Inc	Morgan Stanley	(4.059)	(0,00)
250.691	Sovos Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.371)	(0,00)
188.415	Sovos Brands Inc	Goldman Sachs International	(3.632)	(0,00)
(434.774)	Spirit Airlines Inc	Morgan Stanley	(95.962)	(0,01)
143.106	Splunk Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.185)	(0,00)
962.664	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	(12.473)	(0,00)
10.100	SPX Technologies Inc	Morgan Stanley	(38.881)	(0,00)
(129.460.484)	Square Enix Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(19.631)	(0,00)
(96.060)	Square Inc Class A	Goldman Sachs International	(9.051)	(0,00)
73.221	Squarespace Inc Class A	Morgan Stanley	(2.737)	(0,00)
128.757	Squarespace Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(4.170)	(0,00)
(554.042)	SSAB AB Class B	Morgan Stanley	(8.282)	(0,00)
(57.258)	SSP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.378)	(0,00)
(43.696)	St James's Place Plc	Bank of America Merrill Lynch	(64.867)	(0,00)
(502.158)	STAAR Surgical Co	JPMorgan Chase Bank	(35.695)	(0,00)
(171.063)	STAAR Surgical Co	Morgan Stanley	(18.935)	(0,00)
(52.266)	Stadler Rail AG	Goldman Sachs International	(29.843)	(0,00)
1.592.526	STAG Industrial Inc	Goldman Sachs International	(9.951)	(0,00)
(86.982)	Standard Chartered plc	Bank of America Merrill Lynch	(27.441)	(0,00)
631.419	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	(6.606)	(0,00)
948.106	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs International	(34.280)	(0,00)
(711.612)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	(6.536)	(0,00)
(1.435.386)	Stellantis NV	JPMorgan Chase Bank	(15.609)	(0,00)
(790.791)	Stellantis NV	Morgan Stanley	(48.613)	(0,00)
(697.424)	Stem Inc	Morgan Stanley	(177.298)	(0,01)



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
259.991	STMicroelectronics NV	Goldman Sachs International	(28.737)	(0,00)
311.452	STMicroelectronics NV	Morgan Stanley	(19.590)	(0,00)
(314.881)	Stora Enso OYJ Class R	Morgan Stanley	(7.250)	(0,00)
(1.300)	Strike Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.256)	(0,00)
544.286	Stryker Corp	Goldman Sachs International	(13.549)	(0,00)
4.100	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.568)	(0,00)
1.900	SUMCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(601)	(0,00)
1.900	Sumitomo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118)	(0,00)
3.800	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(57)	(0,00)
(6.500)	Sumitomo Forestry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16)	(0,00)
1.400	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(315)	(0,00)
(2.800)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.983)	(0,00)
(6.500)	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38.600)	(0,00)
(1.100)	Sundrug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.477)	(0,00)
(1.190.705)	Sunnova Energy International Inc	JPMorgan Chase Bank	(168.608)	(0,01)
(1.206.356)	Sunnova Energy International Inc	Morgan Stanley	(215.166)	(0,01)
(1.226.289)	Sunnova Energy International Inc	Goldman Sachs International	(331.597)	(0,01)
132.815	SunPower Corp	Morgan Stanley	(3.084)	(0,00)
(470.725)	Sunrun Inc	Goldman Sachs International	(265.962)	(0,01)
(1.162.457)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(149.485)	(0,01)
(749.891)	Sunrun Inc	JPMorgan Chase Bank	(91.749)	(0,01)
28.900	Suruga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(113)	(0,00)
2.000	Suzuki Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.259)	(0,00)
(15.052.179)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Goldman Sachs International	(43.884)	(0,00)
(11.358.123)	Swedish Orphan Biovitrum AB	JPMorgan Chase Bank	(50.009)	(0,00)
(3.420.779)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Morgan Stanley	(4.350)	(0,00)
295.262	Swiss Life Holding AG	Morgan Stanley	(22.725)	(0,00)
(700)	Sylvamo Corp	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
26.783	Symrise AG	Morgan Stanley	(5.506)	(0,00)
(609.463)	Synopsys Inc	JPMorgan Chase Bank	(10.123)	(0,00)
(10.520)	Synopsys Inc	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
(9.500)	Systema Corp	Bank of America Merrill Lynch	(376)	(0,00)
712.621	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	(27.482)	(0,00)
(11.000)	T&D Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.389)	(0,00)
(8.100)	Tadano Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(588)	(0,00)
(6.500)	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.781)	(0,00)
(3.000)	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.180)	(0,00)
(401.477)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs International	(34.486)	(0,00)
(117.180)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(2.549)	(0,00)
(424.970)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	(32.354)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
4.800	Taiyo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.796)	(0,00)
(1.000)	Takara Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(200)	(0,00)
(18.600)	Takara Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.184)	(0,00)
(6.500)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.905)	(0,00)
1.613.172	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(17.648)	(0,00)
(344.653)	Take-Two Interactive Software Inc	JPMorgan Chase Bank	(48.154)	(0,00)
(700)	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(383)	(0,00)
(13.696)	Targa Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	(66)	(0,00)
199.200	Target Corp	Morgan Stanley	(4.503)	(0,00)
(47.281)	TaskUS Inc Class A	Morgan Stanley	(10.823)	(0,00)
(388.798)	Tate & Lyle Plc	Goldman Sachs International	(27.882)	(0,00)
(150.737)	Tate & Lyle Plc	JPMorgan Chase Bank	(3.227)	(0,00)
1.246.031	Taylor Wimpey Plc	Goldman Sachs International	(4.943)	(0,00)
(7.600)	TBS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.953)	(0,00)
200	TDK Corp	Bank of America Merrill Lynch	(459)	(0,00)
(4.800)	TechMatrix Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.532)	(0,00)
(9.849)	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	(60.106)	(0,00)
(400)	TechnoPro Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(216)	(0,00)
(4.568)	Telefonica SA	Goldman Sachs International	(454)	(0,00)
(193.453)	Telenor ASA	JPMorgan Chase Bank	(1.350)	(0,00)
(4.428.741)	Telenor ASA	Morgan Stanley	(49.392)	(0,00)
(624.595)	Teleperformance	Morgan Stanley	(93.797)	(0,01)
(2.393.509)	Teleperformance	JPMorgan Chase Bank	(522.613)	(0,02)
(800.074)	Teleperformance	Goldman Sachs International	(16.742)	(0,00)
(3.103.768)	Temple & Webster Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.348.708)	(0,05)
(533.240)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs International	(1.293)	(0,00)
2.733.677	Tencent Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(30.040)	(0,00)
5.379.991	Tencent Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	(168.266)	(0,01)
3.929.809	Tencent Holdings Ltd	Morgan Stanley	(207.694)	(0,00)
89.305	Tencent Music Entertainment Group	Goldman Sachs International	(61.726)	(0,00)
779.047	Tencent Music Entertainment Group	JPMorgan Chase Bank	(642.788)	(0,02)
211.865	Tencent Music Entertainment Group	Morgan Stanley	(97.906)	(0,01)
172.817	Tenet Healthcare Corp	Goldman Sachs International	(4.674)	(0,00)
1.521.513	Tenet Healthcare Corp	JPMorgan Chase Bank	(151.519)	(0,01)
483.842	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	(39.793)	(0,00)
(561.156)	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(13.956)	(0,00)
(100)	Terumo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32)	(0,00)
186.022	Tesco Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.362)	(0,00)
157.706	Tesla Inc	Goldman Sachs International	(1.494)	(0,00)
(1.024.261)	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	(39.010)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
717.570	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs International	(892)	(0,00)
(1.303.024)	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	(72.524)	(0,00)
288.501	Texas Instruments Inc	JPMorgan Chase Bank	(26.145)	(0,00)
17.236	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	(56.732)	(0,00)
200.993	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldman Sachs International	(6.790)	(0,00)
203.957	Thermo Fisher Scientific Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.264)	(0,00)
189.516	THG Plc	Bank of America Merrill Lynch	(24.953)	(0,00)
1.280.206	Timken Co	Goldman Sachs International	(56.065)	(0,00)
5.200	TIS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.640)	(0,00)
2.490.603	TJX Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(206.320)	(0,01)
(335.043)	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	(2.277)	(0,00)
(8.800)	Toagosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.137)	(0,00)
387.646	Toast Inc Class A	Morgan Stanley	(7.893)	(0,00)
5.600	Tobu Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(888)	(0,00)
(14.900)	Toda Corp	Bank of America Merrill Lynch	(295)	(0,00)
300	Toei Animation Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(604)	(0,00)
(6.800)	Toho Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18.629)	(0,00)
(28.500)	Tohoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.561)	(0,00)
(29.600)	Tokai Carbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(507)	(0,00)
7.000	Tokai Rika Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(305)	(0,00)
(22.400)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.115)	(0,00)
300	Tokyo Electron Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.629)	(0,00)
(3.900)	Tokyo Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(736)	(0,00)
(2.700)	Tokyo Seimitsu Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(348)	(0,00)
14.000	Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(638)	(0,00)
15.900	Tokyo Tatemono Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15.717)	(0,00)
(18.300)	Tokyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11.250)	(0,00)
26.500	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.361)	(0,00)
(10.020.118)	TOMRA Systems ASA	Morgan Stanley	(238.750)	(0,01)
(8.600)	Tomy Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.712)	(0,00)
5.100	Toppan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.734)	(0,00)
(23.000)	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.599)	(0,00)
2.100	Toshiba TEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(215)	(0,00)
1.300	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(119)	(0,00)
(944.396)	TotalEnergies SE	Morgan Stanley	(421)	(0,00)
(461.634)	Tower Semiconductor Ltd	JPMorgan Chase Bank	(30.561)	(0,00)
(13.345.165)	Toyo Gosei Co Ltd	Morgan Stanley	(8.131)	(0,00)
(1.000)	Toyo Ink SC Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(320)	(0,00)
(300)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40)	(0,00)
5.300	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.859)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
8.600	Toyoda Gosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.593)	(0,00)
4.100	Toyota Boshoku Corp	Bank of America Merrill Lynch	(318)	(0,00)
(1.400)	Toyota Industries Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(0,00)
1.810.623	Tractor Supply Co	JPMorgan Chase Bank	(119.774)	(0,01)
(9.129)	Trainline Plc	Bank of America Merrill Lynch	(452)	(0,00)
304	Trane Technologies Plc	Morgan Stanley	(2.556)	(0,00)
(1.901.713)	Trane Technologies Plc	JPMorgan Chase Bank	(85.946)	(0,00)
(443.441)	Trane Technologies Plc	Goldman Sachs International	(17.361)	(0,00)
2.200	Transcosmos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.002)	(0,00)
(1.041.626)	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	(143.280)	(0,01)
10.921	Travis Perkins Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.462)	(0,00)
1.600	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.236)	(0,00)
692.197	Trip.com Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(53.325)	(0,00)
287.955	Trip.com Group Ltd	Morgan Stanley	(13.046)	(0,00)
(52.554)	Tritium DCFC Ltd	JPMorgan Chase Bank	(47.276)	(0,00)
1.000	Trusco Nakayama Corp	Bank of America Merrill Lynch	(144)	(0,00)
10.111.960	Truworths International Ltd	Goldman Sachs International	(59.679)	(0,00)
(1.800)	Tsuruha Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19.275)	(0,00)
12.200.000	TUI AG	Société Générale	(97.717)	(0,01)
(1.071.003)	Twist Bioscience Corp	Morgan Stanley	(393.911)	(0,01)
32.000	Two Harbors Investment Corp	Morgan Stanley	(11.270)	(0,00)
(1.500)	UACJ Corp	Bank of America Merrill Lynch	(122)	(0,00)
(6.700)	UBE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(928)	(0,00)
(1.200.751)	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	(93.723)	(0,00)
(493.984)	Uber Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(53.317)	(0,00)
(4.985.761)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	(692.410)	(0,02)
17.500.000	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	(900.330)	(0,03)
1.575.211	UCB SA	JPMorgan Chase Bank	(27.992)	(0,00)
196.289	UCB SA	Morgan Stanley	(4.230)	(0,00)
39.600	UDR Inc	Morgan Stanley	(10.688)	(0,00)
(3.651.064)	UDR Inc	Goldman Sachs International	(161.831)	(0,01)
850.181	Umicore SA	JPMorgan Chase Bank	(32.945)	(0,00)
778.027	Umicore SA	Goldman Sachs International	(36.716)	(0,00)
340.816	Umicore SA	Morgan Stanley	(8.916)	(0,00)
(1.500)	Unicharm Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.679)	(0,00)
3.515	Unilever Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.146)	(0,00)
(1.591.406)	uniQure NV	Morgan Stanley	(65.361)	(0,00)
787.345	Universal Health Services Inc Class B	Goldman Sachs International	(23.178)	(0,00)
29.870	Unum Group	Morgan Stanley	(4.811)	(0,00)
(77.219)	UPM-Kymmene OYJ	Morgan Stanley	(2.354)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.633.325	Urban Outfitters Inc	JPMorgan Chase Bank	(80.654)	(0,00)
4.700	UT Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(858)	(0,00)
1.239.913	Valero Energy Corp	Goldman Sachs International	(5.471)	(0,00)
(357.323)	Valmet OYJ	Morgan Stanley	(22.150)	(0,00)
8.900	ValueCommerce Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.660)	(0,00)
(191.381)	Vanguard International Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(4.235)	(0,00)
(71.761)	Vanguard International Semiconductor Corp	JPMorgan Chase Bank	(1.771)	(0,00)
(328.763)	Varex Imaging Corp	JPMorgan Chase Bank	(7.804)	(0,00)
31.157	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	(1.406)	(0,00)
177.933	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs International	(1.549)	(0,00)
326.587	Verizon Communications Inc	JPMorgan Chase Bank	(12.638)	(0,00)
(1.833.360)	Vertex Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.699)	(0,00)
75.770	Verve Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(6.512)	(0,00)
(102.418)	Vestas Wind Systems A/S	Morgan Stanley	(7.978)	(0,00)
(723.506)	Victoria's Secret & Co	JPMorgan Chase Bank	(98.927)	(0,01)
7.661	Victrix Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11.220)	(0,00)
12.700.000	Virgin Galactic Holdings Inc	Goldman Sachs International	(26.731)	(0,00)
(153.251)	Virgin Money UK Plc	Bank of America Merrill Lynch	(85.349)	(0,00)
302.984	Visa Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(15.634)	(0,00)
168.782	Visa Inc Class A	Goldman Sachs International	(2.829)	(0,00)
549.299	Visa Inc Class A	Morgan Stanley	(11.434)	(0,00)
94.811	Vitesco Technologies Group AG	Morgan Stanley	(23.842)	(0,00)
(661.973)	VMware Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(6.173)	(0,00)
372.144	Vodafone Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(30.891)	(0,00)
20.511	Vodafone Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(10.221)	(0,00)
1.611	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs International	(4.766)	(0,00)
8.441	Vodafone Group Plc	Morgan Stanley	(161.912)	(0,01)
(7.377.646)	Volkswagen AG	Morgan Stanley	(36.459)	(0,00)
(12.322)	Volution Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.971)	(0,00)
20.000	Vy Global Growth Warrant	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(1.185.042)	Wacker Chemie AG	Morgan Stanley	(102.099)	(0,01)
(1.300)	Wacoal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(532)	(0,00)
11.300	Wacom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.214)	(0,00)
1.009.922	Walmart Inc	Morgan Stanley	(40.371)	(0,00)
(3.571.780)	Walmart Inc	JPMorgan Chase Bank	(111.303)	(0,01)
(31.375)	Walt Disney Co	JPMorgan Chase Bank	(3.807)	(0,00)
(679.607)	Walt Disney Co	Morgan Stanley	(49.420)	(0,00)
17.348	Warner Music Group Corp	Goldman Sachs International	(716)	(0,00)
371.198	Warner Music Group Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(9.622)	(0,00)
705.993	Wartsila OYJ Abp	Goldman Sachs International	(79.897)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(1.106.191)	Wartsila OYJ Abp	Morgan Stanley	(19.436)	(0,00)
(23.870)	Watches of Switzerland Group	Bank of America Merrill Lynch	(6.839)	(0,00)
201.448	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	(2.137)	(0,00)
(20.366)	Weir Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.294)	(0,00)
177.281	Weir Group Plc	Goldman Sachs International	(11.102)	(0,00)
106.900	Wells Fargo & Co	Morgan Stanley	(84.447)	(0,00)
(1.200)	West Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.320)	(0,00)
(300)	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(281)	(0,00)
(107.216)	Western Digital Corp	JPMorgan Chase Bank	(11.320)	(0,00)
163.078	Western Digital Corp	Goldman Sachs International	(5.467)	(0,00)
(18.112)	Western Digital Corp	Morgan Stanley	(2.593)	(0,00)
36.416	Western Midstream Partners LP	Morgan Stanley	(2.953)	(0,00)
(18.188)	WH Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	(34.935)	(0,00)
(257.115)	Whitbread Plc	Morgan Stanley	(4.186)	(0,00)
(351.295)	Whitbread Plc	JPMorgan Chase Bank	(12.088)	(0,00)
(2.127.638)	Williams Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(91.142)	(0,01)
(1.652.722)	Williams Cos Inc	Morgan Stanley	(48.982)	(0,00)
362.624	Williams-Sonoma Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.008)	(0,00)
(1.248.949)	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	JPMorgan Chase Bank	(73.673)	(0,00)
(2.498.100)	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Goldman Sachs International	(120.694)	(0,01)
(2.198.822)	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Morgan Stanley	(109.802)	(0,01)
93.491	WiseTech Global Ltd	JPMorgan Chase Bank	(21.450)	(0,00)
77.700	WiseTech Global Ltd	Goldman Sachs International	(16.741)	(0,00)
(7.745)	Woodside Energy Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22.424)	(0,00)
(656.751)	Workday Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(19.707)	(0,00)
(1.724.626)	Workday Inc Class A	Goldman Sachs International	(54.174)	(0,00)
(469.802)	Worldline SA	Morgan Stanley	(71.560)	(0,00)
2.138	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	(148)	(0,00)
283.632	WPP Plc	JPMorgan Chase Bank	(37.064)	(0,00)
142.487	WPP Plc	Goldman Sachs International	(15.347)	(0,00)
2.095.698	WW Grainger Inc	Goldman Sachs International	(128.633)	(0,01)
2.100.045	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	(54.880)	(0,00)
(783.391)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	(3.235)	(0,00)
(2.053.635)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs International	(8.005)	(0,00)
7.000	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.799)	(0,00)
67.008	Yara International ASA	Morgan Stanley	(2.409)	(0,00)
3.200.000	Yeahka Ltd	Goldman Sachs International	(12.958)	(0,00)
4.800	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(256)	(0,00)
(4.100)	Yoshinoya Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(140)	(0,00)
24.800	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.834)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2021: (3,82 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
4.355	Zalando SE	Morgan Stanley	(662)	(0,00)
5.521	Zalando SE	Goldman Sachs International	(166)	(0,00)
78.723	Zalando SE	JPMorgan Chase Bank	(38.601)	(0,00)
(3.200)	Zenkoku Hosho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.795)	(0,00)
2.000	Zensho Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(35)	(0,00)
(7.900)	Zeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(359)	(0,00)
(195.605)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs International	(2.060)	(0,00)
130	zooplus SE	Morgan Stanley	(652)	(0,00)
200.000	ZUR Rose Finance BV	Société Générale	(770)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b>			<b>(58.716.225)</b>	<b>(1,88)</b>

### Verkaufte Swaptions (0,02 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Beschreibung	Gegenpartei	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Call Swaptions</b>					
(204.000.000) USD	15.03.2023	USD 10 Year Interest Rate, strike 2.8% Swaption	Morgan Stanley	(625.070)	(0,02)
(480.000.000) EUR	18.01.2023	EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 480,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S38, strike 1.2%	JPMorgan Chase Bank	(82.954)	(0,00)
<b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Swaptions insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: 2.397.766 US\$)</b>				<b>(708.024)</b>	<b>(0,02)</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2021: (0,02 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
13.000.000 EUR	20.12.2024	Nomura International Plc	Buying default protection on POSCO Holdings Inc, 2.75%, 15/07/2024	(130.072)	(0,01)
10.000.000 USD	20.12.2026	Goldman Sachs International	Buying default protection on China Government Bond, 7.50%, 28/10/2027	(145.187)	(0,01)
1.250.000.000 JPY	20.06.2025	JPMorgan Chase Bank	Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(123.814)	(0,00)
500.000.000 JPY	20.12.2026	Goldman Sachs International	Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(51.170)	(0,00)
750.000.000 JPY	20.12.2026	JPMorgan Chase Bank	Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(76.755)	(0,00)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>‡</sup></b>				<b>(526.998)</b>	<b>(0,02)</b>

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,76 %) (31. Dezember 2021: (0,47 %))

Nominalwert	Fällig- keit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens
MXN 71.000	03.11.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,80 %	28D MXIBTIIE	(95)	(0,00)
CZK 460.800.000	27.06.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	Erhalt	6,84 %	6M PRIBOR	(11.259)	(0,00)
MXN 1.006.400.000	26.11.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,22 %	28D MXIBTIIE	(15.910)	(0,00)
MXN 748.000.000	26.11.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,21 %	28D MXIBTIIE	(16.685)	(0,00)
MXN 408.000.000	17.12.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,17 %	28D MXIBTIIE	(16.727)	(0,00)
CLP 33.840.000.000	24.06.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,07 %	1D CLICP	(29.622)	(0,00)
GBP 1.900.000.000	23.03.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,89 %	1D SONIA	(32.134)	(0,00)
GBP 1.504.000.000	23.03.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,88 %	1D SONIA	(49.535)	(0,00)
EUR 1.600.000.000	18.04.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	2,41 %	1D EURIBOR	(52.867)	(0,00)
JPY 108.800.000.000	21.03.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	(0,01 %)	1D JPY LIBOR	(57.581)	(0,00)
GBP 3.800.000.000	23.03.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,88 %	1D SONIA	(125.154)	(0,00)
MXN 1.414.400.000	08.12.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	10,74 %	28D MXIBTIIE	(143.415)	(0,00)
MXN 2.108.000.000	07.12.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	10,80 %	28D MXIBTIIE	(157.798)	(0,00)
MXN 4.114.000.000	01.12.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	10,88 %	28D MXIBTIIE	(186.674)	(0,00)
MXN 4.896.000.000	14.08.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	10,93 %	28D MXIBTIIE	(200.194)	(0,01)
MXN 513.400.000	04.12.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,85 %	28D MXIBTIIE	(244.007)	(0,01)
MXN 513.400.000	05.12.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,78 %	28D MXIBTIIE	(290.361)	(0,01)
MXN 768.400.000	04.12.2025	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,87 %	28D MXIBTIIE	(345.104)	(0,01)
EUR 234.400.000	12.12.2024	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,19 %	1D EURIBOR	(515.622)	(0,02)
USD 16.880.000	15.05.2038	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,24 %	12M SOFR	(515.985)	(0,02)
MXN 312.400.000	11.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,40 %	28D MXIBTIIE	(549.279)	(0,02)
MXN 390.500.000	31.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,44 %	28D MXIBTIIE	(704.075)	(0,02)
MXN 784.800.000	03.05.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,02 %	28D MXIBTIIE	(777.342)	(0,02)
MXN 784.800.000	22.05.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	8,91 %	28D MXIBTIIE	(833.130)	(0,03)
PLN 568.000.000	17.04.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,96 %	1D WIBOR	(963.887)	(0,03)
EUR 1.688.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,24 %	1D EURIBOR	(1.180.769)	(0,04)
MXN 738.300.000	08.09.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	6,30 %	28D MXIBTIIE	(1.208.380)	(0,04)
EUR 1.688.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,17 %	1D EURIBOR	(1.485.892)	(0,05)
MXN 1.164.400.000	11.01.2024	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	7,41 %	28D MXIBTIIE	(2.041.448)	(0,07)
BRL 327.675.708	03.07.2023	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,32 %	1D BROIS	(2.913.512)	(0,09)
BRL 900.980.681	02.01.2023	Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup>	(Zahlung)	9,73 %	1D BROIS	(4.031.088)	(0,13)



## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,76 %) (31. Dezember 2021: (0,47 %)) (Fortsetzung)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettöver- mögens
EUR 2.040.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International (Zahlung)		3,24 %	3M EURIBOR	(4.249.614)	(0,14)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>(23.945.145)</b>	<b>(0,76)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Inflation-Swap-Kontrakte (0,86 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettöver- mögens
EUR 17.457.000	15.11.2026	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,99 %	CPTFEMU	(81.046)	(0,00)
EUR 34.300.000	15.08.2026	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	3,12 %	CPTFEMU	(392.638)	(0,01)
EUR 74.550.000	15.01.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,48 %	CPTFEMU	(7.400.026)	(0,24)
EUR 95.850.000	15.01.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,49 %	CPTFEMU	(9.494.097)	(0,31)
EUR 95.850.000	15.01.2024	LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>	(Zahlung)	2,49 %	CPTFEMU	(9.494.097)	(0,30)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>(26.861.904)</b>	<b>(0,86)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Total Return Swap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2021: (0,24 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettöver- mögens
(21.726) USD	06.11.2024	4,03 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLC <sup>2</sup>	(97)	(0,00)
(577.178) USD	06.11.2024	4,05 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup>	(1.953)	(0,00)
32.039.697 USD	24.04.2023	0,00 <sup>3</sup>	Goldman Sachs Basket GSVIDI1B <sup>4</sup>	(2.527)	(0,00)
(372.128) USD	06.11.2024	4,05 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup>	(4.375)	(0,00)
61.733.087 USD	24.04.2023	0,00 <sup>3</sup>	Goldman Sachs Basket GSVIDI1B <sup>4</sup>	(4.869)	(0,00)
(5.263.694) USD	22.12.2023	1,31 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI <sup>2</sup>	(4.912)	(0,00)
(1.012.016) USD	25.09.2023	1,33 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSXXSTAP <sup>2</sup>	(5.083)	(0,00)
(383.402) USD	06.11.2024	4,06 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI <sup>2</sup>	(8.554)	(0,00)
(816.537) USD	06.11.2024	4,03 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLK <sup>2</sup>	(9.836)	(0,00)
(714.886) USD	06.11.2024	4,11 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup>	(12.113)	(0,00)
(9.900.732) USD	25.09.2023	1,36 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup>	(16.421)	(0,00)
(175.345) USD	06.11.2024	3,99 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSMH <sup>2</sup>	(17.273)	(0,00)
(1.107.155) USD	09.01.2023	1,17 <sup>5</sup>	JPMorgan Basket JP1STP <sup>6</sup>	(25.465)	(0,00)
(830.416) USD	06.11.2024	4,02 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT <sup>2</sup>	(25.622)	(0,00)
(9.034.933) USD	06.11.2024	3,03 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSACHDGE <sup>2</sup>	(27.389)	(0,00)
(1.580.329) USD	06.11.2024	4,09 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUIOH <sup>2</sup>	(27.937)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Total Return Swap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2021: (0,24 %)) (Fortsetzung)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
635.297 USD	06.11.2024	4,11 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup>	(31.019)	(0,00)
(1.063.789) USD	06.11.2024	4,05 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup>	(33.911)	(0,00)
(917.516) EUR	11.03.2024	(0,99) <sup>7</sup>	Morgan Stanley Basket MSABCHE1 <sup>2</sup>	(34.383)	(0,00)
16.757.400 EUR	05.05.2023	0,00 <sup>3</sup>	UBS Basket UBSCFVPR <sup>8</sup>	(51.068)	(0,00)
360.540 USD	24.01.2024	2,01 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUTAN <sup>2</sup>	(58.980)	(0,00)
(2.356.388) USD	06.11.2024	4,11 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLP <sup>2</sup>	(60.608)	(0,00)
(779.072) USD	06.11.2024	4,00 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSABBLD3 <sup>2</sup>	(94.706)	(0,00)
(2.484.682) USD	25.09.2023	1,36 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSNBUXLP <sup>2</sup>	(109.159)	(0,00)
(3.408.565) EUR	12.05.2023	(0,88) <sup>9</sup>	JPMorgan Basket JPECND <sup>6</sup>	(120.889)	(0,01)
2.083.275 GBP	06.11.2024	(0,41) <sup>10</sup>	Morgan Stanley Basket MSABRKMA <sup>2</sup>	(134.111)	(0,01)
(3.438.077) USD	06.11.2024	4,06 <sup>1</sup>	Morgan Stanley Basket MSABSMBP <sup>2</sup>	(139.827)	(0,01)
(4.929.461) USD	09.01.2023	3,92 <sup>5</sup>	JPMorgan Basket JP1STP <sup>6</sup>	(179.335)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>(1.242.422)</b>	<b>(0,04)</b>

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

<sup>3</sup> Fester Zinssatz.

<sup>4</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-OBFR.

<sup>6</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

<sup>7</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 3-Monats-EURIBOR.

<sup>8</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist UBS AG.

<sup>9</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-ESTR.

<sup>10</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SONIA.

### Correlation-Swap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Korrelation zum Ausübungszeitpunkt in Prozent	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
5.000.000 USD	20.12.2024	BNP	Basket of S&P 500 /Nikkei 225 Index correlation swap 20/12/2024	80,50 %	(60.576)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Correlation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(60.576)</b>	<b>(0,00)</b>

### Inflation-Swap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2021: (0,01 %))

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Volatilität-Ausübungssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
200.000 USD	08.12.2023	Goldman Sachs International	Nikkei 225 Index vs S&P 500 Index	Various	(8.962)	(0,00)
400.000 USD	20.12.2024	BNP	BNP US Geo Basket	Various	(14.480)	(0,00)
50.000 EUR	13.01.2023	Bank of America Merrill Lynch	PIMCO Funds Global Investors Series plc Income Fund (PINEEH ID Equity)	5 %	(98.051)	(0,00)

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Inflation-Swap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2021: (0,01 %)) (Fortsetzung)

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Volatilität-Ausübungssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
300.000 USD	20.12.2024	UBS	UBS 24 Names US Basket	Various	(299.754)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(421.247)</b>	<b>(0,01)</b>

### Volatility-Swap-Kontrakte (0,14 %) (31. Dezember 2021: (0,22 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation <sup>1</sup>	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens	
7.500.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 39 Names US Basket	(12.338)	(0,00)	
25.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 7 Names EU Down Geo Basket	(12.831)	(0,00)	
6.000.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Basket	(26.639)	(0,00)	
30.000.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 29 Names US Basket	(29.558)	(0,00)	
10.000.000 USD	22.05.2023	UBS	United States Dollar to Canadian Dollar Rate Basket	(30.852)	(0,00)	
10.000.000 USD	22.05.2023	UBS	New Zealand Dollar to United States Dollar Rate Basket	(31.897)	(0,00)	
15.000.000 USD	16.06.2023	BNP	BNP 11 Names US Basket	(49.002)	(0,00)	
30.000.000 EUR	15.12.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 12 Names EU Basket	(50.370)	(0,00)	
14.000.000 USD	15.09.2023	BNP	BNP Down Pairwise US Basket	(57.687)	(0,00)	
1.000.000 EUR	19.01.2024	BNP	BNP 5 Names EU Basket	(69.765)	(0,00)	
30.000.000 EUR	21.06.2024	Bank of America Merrill Lynch	BAML 14 Names EU Basket	(122.842)	(0,01)	
25.000.000 USD	16.06.2023	BNP	BNP 14 Names US Basket	(124.337)	(0,01)	
25.000.000 USD	16.06.2023	BNP	BNP 14 Names US Basket	(130.468)	(0,01)	
32.000.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 30 Names US Basket	(298.893)	(0,01)	
30.000.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 27 Names US Basket	(353.302)	(0,01)	
16.000.000 USD	18.01.2023	UBS	Chinese Yuan Renminbi vs Mexican Peso Rate Basket	(417.007)	(0,01)	
2.213.090 USD <sup>2</sup>	11.08.2023	Goldman Sachs International	GS 296 Pairwise Theta Flat CoVol	(1.264.449)	(0,04)	
174.971.819 USD <sup>2</sup>	12.01.2024	Goldman Sachs International	GS 300 Pairwise Theta Flat CoVol	(1.335.588)	(0,04)	
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(4.417.825)</b>	<b>(0,14)</b>

<sup>1</sup>Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

<sup>2</sup> Bei Volatilität gehandelter Dispersion-Swap.

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(489.983.868)</b>	<b>(15,65)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>2.065.957.851</b>	<b>66,00</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>1.064.529.131</b>	<b>34,00</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>3.130.486.982</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	207.397.695	5,29
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.681.367.327	42,92
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	61.755.647	1,58
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	115.437.182	2,94
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>2.065.957.851</b>	<b>52,73</b>

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 2,26 %</b>			
<b>US-Dollar</b>			
7.007	Advanced Micro Devices Inc	453.843	0,06
1.263	AECOM	107.267	0,02
1.192	AeroVironment Inc	102.107	0,01
1.875	Amgen Inc	492.450	0,07
11.109	AT&T Inc	204.517	0,03
977	Broadcom Inc	546.270	0,08
33.504	Carnival Corp	270.042	0,04
500	Charles Schwab Corp	41.630	0,01
18.964	Cisco Systems Inc	903.445	0,13
8.130	Cleveland-Cliffs Inc	130.974	0,02
439	Devon Energy Corp	27.003	0,00
6.227	DISH Network Corp Class A	87.427	0,01
2.295	Dollar General Corp	565.144	0,08
9.120	Dollar Tree Inc	1.289.933	0,19
16.041	DuPont de Nemours Inc	1.100.894	0,16
2.660	Eastman Chemical Co	216.630	0,03
5.605	Envestnet Inc	345.828	0,05
848	FTI Consulting Inc	134.662	0,02
1.569	General Mills Inc	131.561	0,02
2.030	Goldman Sachs Group Inc	697.061	0,10
4.102	H&R Block Inc	149.764	0,02
400	HCA Healthcare Inc	95.984	0,01
3.268	Insulet Corp	962.067	0,14
725	Interpublic Group of Cos Inc	24.150	0,00
61	iQIYI Inc ADR	323	0,00
937	ITT Inc	75.991	0,01
147	JM Smucker Co	23.294	0,00
271	Lithia Motors Inc Class A	55.485	0,01
32.950	Lumen Technologies Inc	171.999	0,02
13.306	Lyft Inc Class A	146.632	0,02
797	M&T Bank Corp	115.613	0,02
4.489	Marathon Oil Corp	121.517	0,02
5.110	Marriott Vacations Worldwide Corp	687.755	0,10
12.400	MetLife Inc	897.388	0,13
4.516	Microsoft Corp	1.083.027	0,15
445	Molson Coors Beverage Co Class B	22.926	0,00
4.304	Morgan Stanley	365.926	0,05
3.937	NextEra Energy Partners LP	275.944	0,04
2.767	Ormat Technologies Inc	239.290	0,03
578	PepsiCo Inc	104.421	0,01
490	S&P Global Inc	164.121	0,02
317	Skechers USA Inc Class A	13.298	0,00
3.173	SolarEdge Technologies Inc	898.816	0,13

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung			Zeitwert % des Netto-US\$ vermögens
<b>Aktien 2,26 % (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
1.011	Starbucks Corp			100.291 0,01
2.700	Take-Two Interactive Software Inc			281.151 0,04
29.300	United States Steel Corp			733.965 0,10
10.963	Viatis Inc			122.018 0,02
3.019	Williams Cos Inc			99.325 0,01
445	Winnebago Industries Inc			23.452 0,00
187	Wynn Resorts Ltd			15.422 0,00
6.300	ZTO Express Cayman Inc ADR			169.281 0,02
	<b>Aktien insgesamt *</b>			<b>16.089.324 2,26</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften 0,55 %</b>				
<b>US-Dollar</b>				
40.200	Realty Income Corp			2.549.886 0,35
31.000	Ventas Inc			1.396.550 0,20
	<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>			<b>3.946.436 0,55</b>
Kapitalbetrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Zeitwert % des Netto-US\$ vermögens
<b>Schatzwechsel 63,10 %</b>				
<b>US-Dollar</b>				
45.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	03.01.2023	45.000.000 6,32
46.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	10.01.2023	45.967.687 6,46
30.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	17.01.2023	29.957.140 4,21
40.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	24.01.2023	39.910.499 5,61
41.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	02.02.2023	40.870.087 5,74
45.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.02.2023	44.820.704 6,30
20.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	02.03.2023	19.863.575 2,79
55.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.03.2023	54.488.693 7,65
42.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	13.04.2023	41.526.333 5,83
41.250.000	United States Treasury Bill	0,00 %	20.04.2023	40.712.810 5,72
47.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	08.06.2023	46.082.482 6,47
	<b>Schatzwechsel insgesamt **</b>			<b>449.200.010 63,10</b>
<b>Unternehmensanleihen 1,86 %</b>				
<b>Euro</b>				
2.000.000	Intesa Sanpaolo SpA*	6,38 %	29.12.2049	1.836.912 0,26
3.600.000	Intesa Sanpaolo SpA**	7,75 %	29.12.2049	3.719.633 0,52
	<b>Euro insgesamt</b>			<b>5.556.545 0,78</b>

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung			Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 1,86 % (Fortsetzung)</b>					
<b>Britisches Pfund</b>					
800.000	Lloyds Banking Group Plc*	7,88 %	29.12.2049	921.374	0,13
<b>Britisches Pfund insgesamt</b>				<b>921.374</b>	<b>0,13</b>
<b>US-Dollar</b>					
5.550.000	NatWest Group Plc**	8,00 %	29.12.2049	5.472.716	0,77
1.200.000	ZTO Express Cayman Inc**	1,50 %	01.09.2027	1.270.800	0,18
<b>US-Dollar insgesamt</b>				<b>6.743.516</b>	<b>0,95</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>13.221.435</b>	<b>1,86</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>482.457.205</b>	<b>67,77</b>

### Devisenterminkontrakte (7,65 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
4.947.514 AUD	2.750.000 £	19.01.2023	Bank of America	6	47.944	0,01
2.000.000 AUD	1.829.976 CAD	19.01.2023	Bank of America	1	6.492	0,00
13.900.000 AUD	9.384.095 US\$	19.01.2023	Bank of America	8	48.293	0,01
12.600.000 AUD	1.114.641.694 ¥	19.01.2023	Bank of America	4	84.889	0,01
800.000 AUD	846.534 NZD	19.01.2023	Bank of America	3	7.360	0,00
3.569.065 AUD	2.250.000 €	19.01.2023	Bank of America	6	18.011	0,00
297.511 BRL	55.554 US\$	03.01.2023	Bank of America	1	795	0,00
14.600.000 CAD	10.710.081 US\$	19.01.2023	Bank of America	7	66.029	0,01
724.845 CAD	500.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	795	0,00
1.400.000 CAD	135.331.230 ¥	19.01.2023	Bank of America	4	5.530	0,00
369.110 CAD	400.000 AUD	19.01.2023	Bank of America	2	1.000	0,00
617.207 CHF	625.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	497	0,00
1.990.140 CHF	1.750.000 £	19.01.2023	Bank of America	5	48.753	0,01
4.500.000 CHF	4.834.656 US\$	19.01.2023	Bank of America	5	37.498	0,01
1.211.544.030 CLP	1.400.000 US\$	17.01.2023	Bank of America	6	20.227	0,00
456.217.360 CLP	500.000 US\$	03.01.2023	Bank of America	2	35.498	0,00
799.996.024 CLP	900.000 US\$	09.01.2023	Bank of America	5	38.552	0,01
88.737.856 CLP	100.000 US\$	20.01.2023	Bank of America	1	3.991	0,00
627.459.000 CLP	700.000 US\$	23.01.2023	Bank of America	1	35.086	0,00
127.862.341 CNH	18.400.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	8	103.764	0,01
7.129.000 CNH	1.000.000 US\$	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	32.671	0,00
2.278.301 CZK	100.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	1	573	0,00
625.000 €	6.822.248 SEK	19.01.2023	Bank of America	2	12.395	0,00
750.000 €	738.741 CHF	19.01.2023	Bank of America	4	1.472	0,00
1.200.000 €	168.233.703 ¥	19.01.2023	Bank of America	2	4.411	0,00
15.750.000 €	16.704.538 US\$	19.01.2023	Bank of America	11	122.888	0,02
100.000 €	466.677 PLN	19.01.2023	Bank of America	1	576	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 7,65 % (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
4.625.000 €	6.615.289 CAD	19.01.2023	Bank of America	8	58.712	0,01
42.900.000 €	37.297.691 £	19.01.2023	Bank of America	7	950.186	0,14
2.625.000 €	4.091.776 AUD	19.01.2023	Bank of America	5	27.936	0,00
250.000 €	2.626.581 NOK	19.01.2023	Bank of America	2	297	0,00
332.106.310 HUF	800.000 €	19.01.2023	Bank of America	5	26.106	0,00
391.528.480 HUF	1.000.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	4	38.435	0,01
8.299.387 INR	100.000 US\$	27.01.2023	Bank of America	1	137	0,00
16.584.057 INR	200.000 US\$	09.01.2023	Bank of America	2	373	0,00
2.216.233.884 ¥	24.200.000 AUD	19.01.2023	Bank of America	5	409.702	0,06
4.472.325.640 ¥	31.100.000 €	19.01.2023	Bank of America	8	738.331	0,11
559.991.120 ¥	5.600.000 CAD	19.01.2023	Bank of America	5	119.642	0,02
381.511.506 ¥	4.400.000 NZD	19.01.2023	Bank of America	4	114.044	0,02
1.414.255.919 ¥	8.500.000 £	19.01.2023	Bank of America	8	511.791	0,08
2.875.000.000 ¥	21.332.711 US\$	19.01.2023	Bank of America	5	501.954	0,07
391.759.813 KRW	300.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	11.401	0,00
130.030.189 KRW	100.000 US\$	13.01.2023	Bank of America	1	3.343	0,00
129.490.789 KRW	100.000 US\$	17.01.2023	Bank of America	1	2.924	0,00
258.082.689 KRW	200.000 US\$	25.01.2023	Bank of America	2	5.175	0,00
126.873.789 KRW	100.000 US\$	31.01.2023	Bank of America	1	879	0,00
126.916.789 KRW	100.000 US\$	03.02.2023	Bank of America	1	920	0,00
521.748.789 KRW	400.000 US\$	09.01.2023	Bank of America	2	14.063	0,00
399.256.427 KRW	300.000 US\$	03.01.2023	Bank of America	2	15.743	0,00
521.524.263 KRW	400.000 US\$	20.01.2023	Bank of America	2	14.558	0,00
127.500.000 MXN	6.422.835 US\$	19.01.2023	Bank of America	5	100.708	0,01
1.324.200 NOK	125.000 €	19.01.2023	Bank of America	1	959	0,00
2.000.000 NOK	2.090.480 SEK	19.01.2023	Bank of America	2	2.341	0,00
200.000 NZD	16.600.254 ¥	19.01.2023	Bank of America	1	446	0,00
2.000.000 NZD	1.261.083 US\$	19.01.2023	Bank of America	3	4.102	0,00
1.895.282 PLN	400.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	4.205	0,00
1.589.074 SEK	1.500.000 NOK	19.01.2023	Bank of America	2	283	0,00
269.560 SGD	200.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	1.052	0,00
5.811.348 TRY	300.000 US\$	15.02.2023	Bank of America	1	328	0,00
200.000 US\$	956.826.000 COP	23.01.2023	Bank of America	1	3.396	0,00
300.000 US\$	2.937.938 NOK	19.01.2023	Bank of America	2	1.568	0,00
2.678.906 US\$	4.200.000 NZD	19.01.2023	Bank of America	7	22.015	0,00
400.000 US\$	4.110.564 SEK	19.01.2023	Bank of America	2	5.129	0,00
147.780 US\$	200.000 CAD	19.01.2023	Bank of America	1	162	0,00
4.200.000 US\$	80.887.792 TRY	15.02.2023	Bank of America	5	19.756	0,00
200.000 US\$	6.117.871 TWD	09.01.2023	Bank of America	1	840	0,00
700.000 US\$	3.658.833 BRL	04.01.2023	Bank of America	5	7.006	0,00
300.000 US\$	9.120.146 TWD	17.01.2023	Bank of America	2	2.900	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 7,65 % (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
100.000 US\$	3.044.665 TWD	19.01.2023	Bank of America	1	801	0,00
1.702.288 US\$	2.500.000 AUD	19.01.2023	Bank of America	2	5.816	0,00
9.603.875 US\$	7.875.000 £	19.01.2023	Bank of America	10	126.998	0,02
100.000 US\$	3.054.305 TWD	30.01.2023	Bank of America	1	402	0,00
500.000 US\$	40.987.043 INR	09.01.2023	Bank of America	4	4.783	0,00
200.000 US\$	964.410.000 COP	19.01.2023	Bank of America	1	1.688	0,00
200.000 US\$	965.283.287 COP	31.01.2023	Bank of America	1	1.958	0,00
3.572.789 US\$	469.929.509 ¥	19.01.2023	Bank of America	1	3.832	0,00
100.000 US\$	8.276.113 INR	23.01.2023	Bank of America	1	113	0,00
100.000 US\$	479.589.643 COP	20.01.2023	Bank of America	1	1.400	0,00
1.076.925 US\$	21.000.000 MXN	19.01.2023	Bank of America	4	2.459	0,00
1.518.522 US\$	1.250.000 £	09.01.2023	Goldman Sachs International	3	14.697	0,00
32.138 US\$	250.000 HKD	10.01.2023	Goldman Sachs International	1	101	0,00
6.886.261 ZAR	400.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	4.165	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
658.806.173 €	654.388.581 US\$	18.01.2023	State Street Bank and Trust Co	2	49.433.338	6,95
4.868.869 €	4.848.589 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	50	352.967	0,05
3 US\$	3 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>54.485.356</b>	<b>7,65</b>

### Futures-Kontrakte 1,20 %

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
50	1 Month SOFR Future February 2023	2.542	0,00
(177)	3 Month SOFR Future June 2023	6.017	0,00
(139)	3 Month SOFR Future September 2023	25.963	0,00
53	30 Day Federal Funds Future January 2023	0	0,00
(200)	3-Month Euro Euribor Future January 2023	33.932	0,00
(300)	3-Month Euro Euribor Future February 2023	16.878	0,00
(300)	3-Month Euro Euribor Future March 2023	22.054	0,00
(6)	3-Month Euro Euribor Future March 2024	1.921	0,00
(236)	3-Month Euro Euribor Future December 2023	31.158	0,00
(523)	3-Month Euro Euribor Future September 2023	168.329	0,02
(715)	3-Month Euro Euribor Future June 2023	490.308	0,07
(55)	90-Day Bank Bill Future September 2023	11.537	0,00
9	Australian Dollar Currency Future March 2023	4.762	0,00
(3)	Australian Government Bond 10-Year Future March 2023	5.449	0,00
(20)	Australian Government Bond 3-Year Future March 2023	14.611	0,00
(1)	Bankers Acceptance Future March 2024	129	0,00
(75)	Bankers Acceptance Future September 2023	15.840	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Futures-Kontrakte 1,20 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(55)	CAC40 Index Future January 2023	11.350	0,00
(89)	Canadian 10-Year Bond Future March 2023	84.527	0,01
(8)	Canadian 5-Year Bond Future March 2023	6.074	0,00
127	Canadian Dollar Currency Future March 2023	9.048	0,00
(14)	CBOE VIX Index Future February 2023	7.600	0,00
(29)	CBOE VIX Index Future March 2023	30.823	0,00
(58)	CBOE VIX Index Future January 2023	120.383	0,02
(9)	DAX Index Future March 2023	9.392	0,00
(2)	Dollar Index Future March 2023	342	0,00
403	Euro FX Currency Future March 2023	175.232	0,02
(3)	Euro STOXX 50 Future January 2023	0	0,00
(170)	Euro STOXX 50 Future March 2023	72.418	0,01
400	Euro STOXX 50 Index Dividend Future December 2023	14.826	0,00
7	Euro STOXX Bank Index Future March 2023	496	0,00
(1)	Euro/Japanese Yen Currency Future March 2023	5.012	0,00
(624)	Euro-BOBL Future March 2023	954.975	0,14
1	Euro-BTP Future January 2023	216	0,00
(106)	Euro-BTP Future March 2023	858.752	0,13
120	Euro-Bund Future February 2023	926.098	0,14
(351)	Euro-Bund Future March 2023	899.820	0,14
(4)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2023	42.391	0,01
(207)	Euro-OAT Future March 2023	1.903.160	0,28
(1.272)	Euro-Schatz Future March 2023	242.789	0,03
(59)	FTSE 100 Index Future March 2023	23.373	0,00
2	FTSE China A50 Index Future July 2023	59	0,00
(7)	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2023	32.741	0,00
49	Japanese Yen Currency Future March 2023	30.007	0,00
(1)	Mini-Hang Seng Index Future January 2023	254	0,00
136	New Zealand Dollar Currency Future March 2023	9.798	0,00
(1)	Nikkei 225 (CME) Future March 2023	3.200	0,00
(5)	Nikkei 225 (OSE) Future March 2023	10.156	0,00
(8)	Nikkei 225 (SGX) Future March 2023	13.718	0,00
(3)	Nikkei 225 Mini Future March 2023	326	0,00
(64)	S&P 500 E-mini Future March 2023	109.387	0,02
1	S&P 500 Micro E-mini Future March 2023	50	0,00
4	SGX Nifty 50 Future January 2023	410	0,00
(1)	Short-Term Euro-BTP Future March 2023	0	0,00
(13)	SPI 200 Index Future March 2023	17.547	0,00
94	Swiss Franc Currency Future March 2023	42.441	0,01
3	TOPIX Index Future March 2023	568	0,00
3	Turkish Lira Currency Future February 2023	11	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 1,20 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(8)	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	15.842	0,00
(194)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	151.081	0,02
(4)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2023	125	0,00
(714)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2023	542.499	0,09
(215)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2023	265.089	0,04
(6)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2023	3.625	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>8.521.839</b>	<b>1,20</b>

### Gekaufte Optionskontrakte 5,04 %

Anzahl Kontrakte/Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufoptionen</b>				
1.000	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	557.500	0,08
1.900	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$96 ±	20.625	0,00
800	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$96 ±	22.500	0,00
300	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$97 ±	1.875	0,00
400	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$97 ±	2.500	0,00
2.500.000 US\$	20.01.2023	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 26% ∞	157	0,00
2.500.000 US\$	17.02.2023	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 36% ∞	110	0,00
2.500.000 EUR	09.01.2023	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 23% ∞	139	0,00
9	16.06.2023	AECOM, Strike Price \$93 ±	2.520	0,00
7	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$100 ±	4.270	0,00
40.090	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$115 ∞	115.870	0,02
100.000	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$152 ∞	25.234	0,01
257	20.01.2023	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$88 ±	41.762	0,01
22	21.04.2023	Allstate Corp, Strike Price \$145 ±	9.130	0,00
42	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$285 ±	1.155	0,00
900.000.000 JPY	05.09.2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 52bps. ∞	0	0,00
180.000.000 JPY	20.08.2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. ∞	0	0,00
11.737	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$43 ∞	249.815	0,04
100.000	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$51 ∞	1.798.506	0,25
502	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$24 ±	502	0,00
4	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$210 ±	2.980	0,00
1	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$570 ±	4.840	0,00
1	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$580 ±	3.200	0,00
38	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$110 ±	855	0,00
8	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$90 ±	3.200	0,00
14.074	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105 ∞	61.941	0,01
50.000	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$133 ∞	125.543	0,02
107	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$320 ±	161.035	0,02

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
2	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$350 ±	3.710	0,00
15	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$53 ±	2.295	0,00
161	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$23 ±	3.783	0,00
2	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$95 ±	190	0,00
250.000.000 JPY	16.11.2029	Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 170bps. ∞	313.178	0,04
350.000.000 JPY	17.02.2023	Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 90bps. ∞	2.321	0,00
2	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$165 ±	285	0,00
241.499	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21 ∞	269.298	0,04
241.499	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21 ∞	306.042	0,04
241.499	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR22 ∞	213.918	0,03
241.499	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR22 ∞	247.797	0,03
3	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$80 ±	345	0,00
162	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$190 ±	486	0,00
400.000 USD	16.06.2023	Dual digital option: S&P 500 index and SOFR rate, Strike Price \$3,555 and 3.86% ∞	18.640	0,00
200.000 USD	15.12.2023	Dual digital option: Euro Stoxx 50 index and EUR/USD spot rate, Strike Price \$4,000 and 1.1 ∞	55.181	0,01
3	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$80 ±	300	0,00
40	20.01.2023	Eastman Chemical Co, Strike Price \$110 ±	600	0,00
30.000	19.09.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$111 ∞	324.229	0,05
30.000	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$111 ∞	329.644	0,05
30.000	19.11.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$111 ∞	336.977	0,05
25.200	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	500.431	0,07
31	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,825 ±	15.351	0,00
48	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,900 ±	41.597	0,01
20	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,075 ±	6.083	0,00
120	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,275 ±	8.453	0,00
2	16.06.2023	FactSet Research Systems Inc, Strike Price \$500 ±	830	0,00
300.000.000 JPY	18.03.2024	Fancl Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. ∞	23.536	0,00
18	21.04.2023	FedEx Corp, Strike Price \$195 ±	10.260	0,00
6	21.04.2023	Fluor Corp, Strike Price \$40 ±	990	0,00
3	21.04.2023	General Mills Inc, Strike Price \$88 ±	735	0,00
9	16.06.2023	General Mills Inc, Strike Price \$90 ±	2.295	0,00
200.000.000 JPY	08.06.2026	GMO Payment Gateway Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. ∞	75.101	0,01
337.500	07.12.2023	Gold Spot US Dollar Index, Strike Price \$1,575 ∞	41.344	0,01
7.317	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$108 ∞	4.537	0,00
50.000	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$126 ∞	24.193	0,01
113	17.03.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$48 ±	7.345	0,00
400.000.000 JPY	01.11.2024	HIS Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 58bps. ∞	0	0,00
100.000.000 JPY	05.09.2024	Hosele Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. ∞	21.787	0,00
10.483	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$294 ∞	630.443	0,09

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
20	16.06.2023	Insulet Corp, Strike Price \$310 ±	62.000	0,01
50.000	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$317 ∞	2.474.451	0,35
7	21.04.2023	Interpublic Group of Cos Inc, Strike Price \$36 ±	805	0,00
8	16.06.2023	ITT Inc, Strike Price \$95 ±	1.980	0,00
250.000.000 JPY	14.02.2023	Jins Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. ∞	0	0,00
2	21.04.2023	JM Smucker Co, Strike Price \$160 ±	1.390	0,00
5	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$195 ±	1.218	0,00
199	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$22 ±	995	0,00
4	16.06.2023	Keysight Technologies Inc, Strike Price \$195 ±	2.460	0,00
6	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$145 ±	2.490	0,00
130.000.000 JPY	20.12.2024	Koei Tecmo Holdings Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞	65.031	0,01
2	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW293 ±	1.333	0,00
1	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW295 ±	461	0,00
4	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW298 ±	1.186	0,00
15	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW325 ±	59	0,00
4	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW328 ±	8	0,00
29	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW330 ±	57	0,00
3	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW333 ±	6	0,00
7	21.04.2023	Kraft Heinz Co, Strike Price \$43 ±	962	0,00
300.000.000 JPY	15.01.2026	Kyoritsu Maintenance, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 105bps. ∞	744.106	0,10
300.000.000 JPY	13.01.2026	Kyoritsu Maintenance, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. ∞	718.612	0,10
718	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$33 ±	22.976	0,00
387	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$40 ±	6.385	0,00
42.205	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$42 ∞	6.071	0,00
200.000	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$49 ∞	17.598	0,00
344	20.01.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$100 ±	3.440	0,00
43	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$105 ±	967	0,00
24	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$33 ±	3.924	0,00
8.507	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$153 ∞	118.440	0,02
30.661	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$197 ∞	134.775	0,02
224	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$110 ±	13.664	0,00
351	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$115 ±	16.321	0,00
3.193	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$126 ∞	750	0,00
31.126	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$133 ∞	5.598	0,00
218	20.01.2023	Match Group Inc, Strike Price \$145 ±	0	0,00
22	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$170 ±	847	0,00
10.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$172 ∞	532	0,00
100.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$182 ∞	4.072	0,00
140.000.000 JPY	29.01.2025	Menicon Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. ∞	63.535	0,01

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
250.000.000 JPY	29.06.2026	Mercari Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 120bps. ∞	0	0,00
13	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$335 ±	162	0,00
17.159	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$178 ∞	151.022	0,02
25.002	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$193 ∞	162.799	0,02
60.000	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$201 ∞	334.413	0,05
75.000	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$227 ∞	267.964	0,04
4	21.04.2023	Molson Coors Beverage Co, Strike Price \$58 ±	360	0,00
395	17.03.2023	MSCI World Index, Strike Price \$2,278 ∞	3.850	0,00
1,030.000.000 JPY	12.11.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 38bps. ∞	171.947	0,02
500.000.000 JPY	27.11.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 45bps. ∞	71.165	0,01
380.000.000 JPY	27.11.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞	62.274	0,01
3	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,750 ±	296	0,00
29	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,875 ±	2.418	0,00
3	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,000 ±	205	0,00
1	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,125 ±	61	0,00
1	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,250 ±	45	0,00
300.000.000 JPY	04.10.2024	Nippon 24, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. ∞	187.601	0,03
300.000.000 JPY	05.10.2026	Nippon 26, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 65bps. ∞	289.055	0,04
400.000.000 JPY	16.09.2024	Nipro Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps ∞	29.508	0,01
135	21.04.2023	NiSource Inc, Strike Price \$30 ±	7.425	0,00
1.026	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$170 ±	175.959	0,02
12.335	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$220 ∞	7.505	0,00
50.000	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$258 ∞	16.093	0,00
175	17.03.2023	Omega Healthcare Investors Inc, Strike Price \$36 ±	2.187	0,00
4	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$200 ±	1.242	0,00
480.000 USD	20.03.2023	GBP/USD & USD/JPY dual digital (both Down Knock Ins), Strike Prices: \$1.12 & JPY139.5 ∞	23.522	0,00
5	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$25 ±	1.137	0,00
3.028	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$27 ±	317.940	0,04
72.984	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$31 ∞	8.240	0,00
300.000	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$39 ∞	2.016	0,00
597	20.01.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$80 ±	8.955	0,00
66	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$85 ±	330	0,00
250.000.000 JPY	17.11.2027	Relo Group Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 87bps. ∞	62.732	0,01
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,850 ±	4.100	0,00
4	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,860 ±	15.300	0,00
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,900 ±	2.838	0,00
157	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,950 ±	286.525	0,04
6	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,600 ±	195.180	0,03
8	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,850 ±	126.760	0,02

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
4	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,855 ±	62.260	0,01
4	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,860 ±	61.160	0,01
6	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,040 ±	42.120	0,01
2	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,190 ±	245	0,00
1	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,225 ±	2.450	0,00
30	15.12.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 ±	473.700	0,07
157	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$200 ±	157	0,00
12.140	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$83 ∞	716.787	0,10
100.000	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$97 ∞	4.995.136	0,70
1,500.000.000 JPY	11.07.2025	SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. ∞	821.514	0,12
300,000.000 JPY	17.03.2026	Seino Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. ∞	4.021	0,00
5	21.04.2023	Skechers USA Inc, Strike Price \$45 ±	1.350	0,00
10	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$370 ±	8.150	0,00
7	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$105 ±	4.445	0,00
130,000.000 JPY	13.02.2023	Sumitomo Metal Mining Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 30bps. ∞	0	0,00
239	20.01.2023	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$30 ±	1.195	0,00
16.873	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$38 ∞	27.554	0,01
100.000	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$48 ∞	93.459	0,01
250,000.000 JPY	06.12.2023	Takashimaya Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 35bps. ∞	114.766	0,02
200,000.000 JPY	13.11.2026	Transcosmos Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 45bps. ∞	157.541	0,02
17	16.06.2023	Unum Group, Strike Price \$45 ±	3.485	0,00
200	27.01.2023	US Treasury 10-Year Note Futures, Strike Price \$116 ±	21.875	0,00
606	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$58 ±	3.030	0,00
80	18.01.2023	VIX Index, Strike Price \$27 ±	4.960	0,00
200	18.01.2023	VIX Index, Strike Price \$35 ±	4.700	0,00
203	20.01.2023	Wayfair Inc, Strike Price \$160 ±	0	0,00
119	20.01.2023	Wayfair Inc, Strike Price \$190 ±	0	0,00
55	20.01.2023	Wayfair Inc, Strike Price \$195 ±	0	0,00
60	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$195 ±	4.050	0,00
4.618	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$210 ∞	904	0,00
9.429	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$253 ∞	1.023	0,00
20.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$268 ∞	1.802	0,00
40.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$322 ∞	2.006	0,00
23	16.06.2023	Williams Companies Inc, Strike Price \$37 ±	2.243	0,00
3	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$70 ±	270	0,00
700,000.000 JPY	21.05.2024	Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. ∞	797.010	0,11

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen</b>				
400	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$93 <sup>±</sup>	2.500	0,00
800	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$94 <sup>±</sup>	5.000	0,00
400	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 <sup>±</sup>	12.500	0,00
400	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 <sup>±</sup>	42.500	0,01
1.200	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 <sup>±</sup>	307.500	0,04
294	16.06.2023	Accor SA, Strike Price EUR12 <sup>±</sup>	3.765	0,00
111	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$65 <sup>±</sup>	35.797	0,01
92	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$78 <sup>±</sup>	118.680	0,02
11	16.06.2023	AECOM, Strike Price \$73 <sup>±</sup>	2.118	0,00
8	16.06.2023	AECOM, Strike Price \$85 <sup>±</sup>	4.000	0,00
13	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$65 <sup>±</sup>	4.160	0,00
10	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$75 <sup>±</sup>	5.900	0,00
8	16.06.2023	AeroVironment Inc, Strike Price \$90 <sup>±</sup>	10.080	0,00
470	20.01.2023	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$65 <sup>±</sup>	0	0,00
34	21.04.2023	Allstate Corp, Strike Price \$110 <sup>±</sup>	4.505	0,00
21	21.04.2023	Allstate Corp, Strike Price \$130 <sup>±</sup>	10.815	0,00
1.500	17.02.2023	American Airlines Group Inc, Strike Price \$10 <sup>±</sup>	30.750	0,01
3.812	19.05.2023	American Airlines Group Inc, Strike Price \$9 <sup>±</sup>	146.762	0,02
94	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$175 <sup>±</sup>	0	0,00
42	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$210 <sup>±</sup>	210	0,00
28	20.01.2023	Amgen Inc, Strike Price \$245 <sup>±</sup>	3.024	0,00
8.727	16.06.2023	ams AG, Strike Price CHF4 <sup>±</sup>	216.949	0,03
4.842	17.03.2023	ams AG, Strike Price CHF6 <sup>±</sup>	146.537	0,02
432	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$18 <sup>±</sup>	13.176	0,00
341	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$21 <sup>±</sup>	97.526	0,01
7	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$130 <sup>±</sup>	4.690	0,00
5	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$160 <sup>±</sup>	8.125	0,00
4	16.06.2023	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$185 <sup>±</sup>	11.940	0,00
11.493	16.06.2023	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3 <sup>±</sup>	24.532	0,00
850	16.06.2023	Banco BPM SpA, Strike Price EUR2 <sup>±</sup>	29.936	0,01
1	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$360 <sup>±</sup>	195	0,00
3	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$360 <sup>±</sup>	1.305	0,00
1	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$430 <sup>±</sup>	595	0,00
2	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$440 <sup>±</sup>	2.520	0,00
14	20.01.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$480 <sup>±</sup>	1.470	0,00
1	21.04.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$510 <sup>±</sup>	2.020	0,00
1	16.06.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$510 <sup>±</sup>	2.790	0,00
2.305	16.06.2023	Carnival Corp, Strike Price \$6 <sup>±</sup>	149.825	0,02



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
72	03.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,500 ±	900	0,00
3.350	16.06.2023	Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR26 ±	382.556	0,05
17	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$60 ±	1.785	0,00
94	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$65 ±	5.875	0,00
11	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$70 ±	2.613	0,00
49	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$80 ±	16.660	0,00
8	16.06.2023	Centene Corp, Strike Price \$83 ±	5.000	0,00
35	17.03.2023	Centene Corp, Strike Price \$95 ±	46.025	0,01
99	17.03.2023	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$40 ±	5.197	0,00
78	17.03.2023	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$70 ±	70.980	0,01
2	17.03.2023	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,660 ±	55.430	0,01
250	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$195 ±	0	0,00
6	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$220 ±	1.125	0,00
122	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$240 ±	610	0,00
3	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$270 ±	1.740	0,00
94	20.01.2023	Cigna Corp, Strike Price \$280 ±	4.465	0,00
2	16.06.2023	Cigna Corp, Strike Price \$320 ±	3.630	0,00
78	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$33 ±	2.496	0,00
21	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$40 ±	2.195	0,00
166	20.01.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$42 ±	1.328	0,00
14	16.06.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$48 ±	4.620	0,00
272	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$14 ±	23.936	0,00
197	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$17 ±	43.832	0,01
170	17.03.2023	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$20 ±	73.950	0,01
6	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$60 ±	570	0,00
3	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$70 ±	832	0,00
2	21.04.2023	CoStar Group Inc, Strike Price \$85 ±	1.960	0,00
11.454	16.06.2023	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR5 ±	73.346	0,01
5.985	16.06.2023	Credit Suisse Group AG, Strike Price CHF3 ±	426.946	0,06
74	20.01.2023	CVS Caremark Corp, Strike Price \$95 ±	24.235	0,00
3	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$100 ±	292	0,00
2	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$125 ±	890	0,00
1	21.04.2023	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$145 ±	1.290	0,00
7.340	17.03.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR4 ±	31.334	0,01
1.600	16.06.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR4 ±	14.515	0,00
2.060	17.03.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR5 ±	13.191	0,00
960	15.09.2023	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR6 ±	29.712	0,01
3.500	15.12.2023	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR12 ±	93.384	0,01
155.000	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	180.346	0,03
155.000	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	187.010	0,03

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
5	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$50 ±	1.135	0,00
3	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$60 ±	1.747	0,00
3	21.04.2023	Devon Energy Corp, Strike Price \$70 ±	3.577	0,00
199	17.03.2023	DiaSorin Italia SpA, Strike Price EUR94 ±	19.864	0,00
82	17.03.2023	DiaSorin Italia SpA, Strike Price EUR96 ±	8.669	0,00
28	20.01.2023	Dollar General Corp, Strike Price \$250 ±	21.000	0,00
359	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$115 ±	3.590	0,00
209	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$140 ±	66.357	0,01
160	20.01.2023	Dollar Tree Inc, Strike Price \$165 ±	380.400	0,05
505	17.03.2023	Dufry AG, Strike Price CHF22 ±	15.010	0,00
620	17.03.2023	Dufry AG, Strike Price CHF24 ±	23.454	0,00
1.606	16.06.2023	Dufry AG, Strike Price CHF26 ±	190.943	0,03
110	17.03.2023	Dufry AG, Strike Price CHF28 ±	6.599	0,00
134	15.09.2023	Dufry AG, Strike Price CHF28 ±	25.346	0,00
8	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$50 ±	240	0,00
4	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$60 ±	550	0,00
3	21.04.2023	DuPont de Nemours Inc, Strike Price \$70 ±	1.470	0,00
40	20.01.2023	Eastman Chemical Co, Strike Price \$65 ±	600	0,00
50	17.03.2023	Edenred, Strike Price EUR38 ±	1.654	0,00
450	19.05.2023	Envestnet Inc, Strike Price \$45 ±	78.750	0,01
862	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,273 <sup>oo</sup>	28.035	0,01
240	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,300 ±	67.877	0,01
114	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,625 ±	24.942	0,00
32	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,800 ±	26.126	0,01
4	20.01.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,825 ±	3.838	0,00
32	17.03.2023	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR3,900 ±	66.835	0,01
1	16.06.2023	FactSet Research Systems Inc, Strike Price \$380 ±	1.925	0,00
2	16.06.2023	FactSet Research Systems Inc, Strike Price \$450 ±	11.290	0,00
19	21.04.2023	FedEx Corp, Strike Price \$150 ±	10.165	0,00
16	21.04.2023	FedEx Corp, Strike Price \$175 ±	22.280	0,00
2	21.04.2023	Fluor Corp, Strike Price \$23 ±	50	0,00
34	21.04.2023	Fluor Corp, Strike Price \$30 ±	4.845	0,00
2.382	17.03.2023	Ford Motor Co, Strike Price \$11 ±	164.358	0,02
10	16.06.2023	FTI Consulting Inc, Strike Price \$120 ±	2.800	0,00
6	16.06.2023	FTI Consulting Inc, Strike Price \$145 ±	4.110	0,00
4	16.06.2023	FTI Consulting Inc, Strike Price \$175 ±	8.520	0,00
8	21.04.2023	General Mills Inc, Strike Price \$55 ±	56	0,00
4	21.04.2023	General Mills Inc, Strike Price \$65 ±	140	0,00
12	16.06.2023	General Mills Inc, Strike Price \$70 ±	1.260	0,00
9	16.06.2023	General Mills Inc, Strike Price \$80 ±	2.880	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
400	16.06.2023	Glencore Plc, Strike Price GBP350 ±	29.116	0,01
77	21.04.2023	Guardant Health Inc, Strike Price \$18 ±	7.315	0,00
20	16.06.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$37 ±	6.800	0,00
109	17.03.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$42 ±	67.580	0,01
16	16.06.2023	H&R Block Inc, Strike Price \$42 ±	10.560	0,00
167	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,600 ±	157.266	0,02
1.862	16.06.2023	Herbalife Nutrition Ltd, Strike Price \$10 ±	172.235	0,02
1.014	16.06.2023	Idorsia Ltd, Strike Price CHF10 ±	132.065	0,02
190	16.06.2023	Idorsia Ltd, Strike Price CHF9 ±	21.768	0,00
2.542	16.06.2023	ING Groep NV, Strike Price EUR7 ±	23.752	0,00
57	17.03.2023	Insulet Corp, Strike Price \$210 ±	17.955	0,00
4.910	17.03.2023	International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP80 ±	88.594	0,01
6	21.04.2023	Interpublic Group of Cos Inc, Strike Price \$31 ±	765	0,00
3.700	15.09.2023	Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1 ±	184.859	0,03
3	16.06.2023	iQIYI Inc, Strike Price \$2 ±	107	0,00
2	16.06.2023	ITT Inc, Strike Price \$70 ±	560	0,00
8	16.06.2023	ITT Inc, Strike Price \$85 ±	6.680	0,00
1	21.04.2023	JM Smucker Co, Strike Price \$140 ±	177	0,00
16	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$125 ±	848	0,00
7	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$150 ±	1.239	0,00
4	16.06.2023	Johnson & Johnson, Strike Price \$175 ±	2.920	0,00
1.400	15.09.2023	Just Eat Takeaway.com NV, Strike Price EUR13 ±	162.115	0,02
444	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$13 ±	4.440	0,00
232	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$16 ±	12.180	0,00
173	17.03.2023	KeyCorp, Strike Price \$19 ±	34.600	0,01
10	16.06.2023	Keysight Technologies Inc, Strike Price \$125 ±	2.600	0,00
5	16.06.2023	Keysight Technologies Inc, Strike Price \$150 ±	2.875	0,00
2	16.06.2023	Keysight Technologies Inc, Strike Price \$175 ±	2.950	0,00
9	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$110 ±	1.260	0,00
5	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$130 ±	2.700	0,00
20	16.06.2023	Kimberly-Clark Corp, Strike Price \$90 ±	750	0,00
4	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW290 ±	2.404	0,00
2	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW298 ±	2.958	0,00
19	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW300 ±	35.498	0,01
16	12.01.2023	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW305 ±	43.812	0,01
19	21.04.2023	Kraft Heinz Co, Strike Price \$25 ±	95	0,00
9	21.04.2023	Kroger Co, Strike Price \$35 ±	351	0,00
6	21.04.2023	Kroger Co, Strike Price \$40 ±	714	0,00
4	21.04.2023	Kroger Co, Strike Price \$47 ±	1.640	0,00
4.301	16.06.2023	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24 ±	10.347	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
3.200	15.09.2023	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24 ±	11.548	0,00
1.683	20.01.2023	Luminar Technologies Inc, Strike Price \$5 ±	71.527	0,01
1	17.03.2023	Lyft Inc, Strike Price \$10 ±	110	0,00
1	21.04.2023	Lyft Inc, Strike Price \$13 ±	265	0,00
1.064	21.04.2023	Lyft Inc, Strike Price \$8 ±	48.412	0,01
647	20.01.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$60 ±	0	0,00
93	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$60 ±	3.487	0,00
364	20.01.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$75 ±	11.830	0,00
48	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$75 ±	10.680	0,00
307	20.01.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$85 ±	98.240	0,01
36	17.03.2023	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$90 ±	33.480	0,01
5	16.06.2023	M&T Bank Corp, Strike Price \$145 ±	6.025	0,00
4	16.06.2023	M&T Bank Corp, Strike Price \$170 ±	10.860	0,00
38	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$21 ±	4.427	0,00
12	21.04.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$23 ±	1.440	0,00
26	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$26 ±	7.514	0,00
7	21.04.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$28 ±	2.275	0,00
6	21.04.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$32 ±	3.555	0,00
265	21.07.2023	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$100 ±	107.325	0,02
110	20.01.2023	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$85 ±	6.600	0,00
16	21.04.2023	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$85 ±	1.160	0,00
200	17.03.2023	Match Group Inc, Strike Price \$35 ±	39.300	0,01
94	17.03.2023	Match Group Inc, Strike Price \$40 ±	35.485	0,01
13	17.03.2023	McDonalds Corp, Strike Price \$260 ±	10.595	0,00
74	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$55 ±	2.035	0,00
50	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$65 ±	5.750	0,00
16	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$245 ±	25.920	0,00
24	16.06.2023	Marathon Oil Corp, Strike Price \$30 ±	12.180	0,00
28	20.01.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$255 ±	46.130	0,01
11	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$290 ±	55.550	0,01
425	17.03.2023	Middleby Corp, Strike Price \$105 ±	88.188	0,01
220	17.03.2023	Middleby Corp, Strike Price \$95 ±	23.650	0,00
5	21.04.2023	Molson Coors Beverage Co, Strike Price \$43 ±	287	0,00
4	21.04.2023	Molson Coors Beverage Co, Strike Price \$50 ±	900	0,00
3.426	16.06.2023	Natwest Group Plc, Strike Price GBP121 ±	10.251	0,00
21	17.03.2023	Neoen SA, Strike Price EUR28 ±	1.132	0,00
1.040	16.03.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR5 ±	13.042	0,00
4.480	16.03.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR6 ±	75.305	0,01
1.210	17.03.2023	Nexi SpA, Strike Price EUR6 ±	111.117	0,02
300	21.07.2023	NextEra Energy Inc, Strike Price \$55 ±	50.250	0,01

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
29	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,875 ±	394.520	0,06
1	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,000 ±	14.514	0,00
1	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,125 ±	15.461	0,00
171	21.04.2023	NiSource Inc, Strike Price \$23 ±	3.847	0,00
120	21.04.2023	NiSource Inc, Strike Price \$25 ±	5.400	0,00
81	16.06.2023	Ocado Group Plc, Strike Price GBP400 ±	52.371	0,01
245	17.03.2023	Ocado Group Plc, Strike Price GBP520 ±	162.459	0,02
200	17.02.2023	Ocado Group Plc, Strike Price GBP550 ±	115.478	0,02
117	17.02.2023	Okta Inc, Strike Price \$65 ±	52.943	0,01
189	17.03.2023	Omega Healthcare Investors Inc, Strike Price \$26 ±	17.010	0,00
131	17.03.2023	Omega Healthcare Investors Inc, Strike Price \$31 ±	49.125	0,01
200	16.06.2023	Ormat Technologies Inc, Strike Price \$65 ±	34.000	0,01
15	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$125 ±	1.013	0,00
6	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$155 ±	1.548	0,00
4	16.06.2023	PepsiCo Inc, Strike Price \$180 ±	3.520	0,00
1.143	20.01.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$48 ±	1.143	0,00
503	20.01.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$60 ±	15.090	0,00
67	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$63 ±	14.237	0,00
379	20.01.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$70 ±	248.245	0,03
45	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$75 ±	52.200	0,01
29	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,110 ±	1.233	0,00
198	31.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,550 ±	138.600	0,02
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,700 ±	1.250	0,00
3	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,860 ±	11.325	0,00
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,870 ±	4.013	0,00
3	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,950 ±	18.788	0,00
160	17.02.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,950 ±	1.324.000	0,19
6	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,000 ±	48.000	0,01
1	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,050 ±	10.013	0,00
20	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,400 ±	4.550	0,00
6	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,040 ±	148.470	0,02
5	16.06.2023	S&P Global Inc, Strike Price \$250 ±	2.075	0,00
3	16.06.2023	S&P Global Inc, Strike Price \$300 ±	3.630	0,00
2	16.06.2023	S&P Global Inc, Strike Price \$350 ±	6.340	0,00
215	17.03.2023	Safran SA, Strike Price EUR70 ±	8.490	0,00
315	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$120 ±	32.445	0,01
198	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$145 ±	259.875	0,04
155	20.01.2023	Salesforce Inc, Strike Price \$170 ±	579.312	0,08
3	20.01.2023	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$40 ±	0	0,00
180.000	15.06.2023	Sasol Ltd, Strike Price ZAR22,500 <sup>o</sup>	191.409	0,03

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
140.000	15.06.2023	Sasol Ltd, Strike Price ZAR23,500 <sup>oo</sup>	176.850	0,02
2.959	15.12.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR10 <sup>±</sup>	156.321	0,02
88	16.06.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR14 <sup>±</sup>	6.809	0,00
1.384	17.03.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR15 <sup>±</sup>	70.900	0,01
675	15.12.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR8 <sup>±</sup>	17.650	0,00
16	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$230 <sup>±</sup>	18.960	0,00
12	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$280 <sup>±</sup>	36.180	0,01
10	17.03.2023	SolarEdge Technologies Inc, Strike Price \$320 <sup>±</sup>	53.450	0,01
16	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$70 <sup>±</sup>	1.800	0,00
10	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$83 <sup>±</sup>	2.720	0,00
7	16.06.2023	Starbucks Corp, Strike Price \$98 <sup>±</sup>	5.058	0,00
140	21.04.2023	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$13 <sup>±</sup>	11.900	0,00
661	17.03.2023	Swiss Re AG, Strike Price CHF56 <sup>±</sup>	12.860	0,00
27	17.03.2023	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$125 <sup>±</sup>	58.927	0,01
43	17.03.2023	Texas Roadhouse Inc, Strike Price \$95 <sup>±</sup>	32.680	0,01
1.944	17.03.2023	The Walt Disney Company, Strike Price \$10 <sup>±</sup>	72.900	0,01
2	20.01.2023	The Walt Disney Company, Strike Price \$13 <sup>±</sup>	50	0,00
1.155	17.03.2023	The Walt Disney Company, Strike Price \$13 <sup>±</sup>	109.725	0,02
29.300	17.03.2023	TUI AG, Strike Price EUR1 <sup>±</sup>	187.623	0,03
5.368	16.06.2023	UBS Group AG, Strike Price CHF9 <sup>±</sup>	37.713	0,01
2.000.000 USD	03.02.2023	United States Dollar/Turkish Lira Currency Option, Strike Price \$19 <sup>oo</sup>	26.804	0,01
159	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$21 <sup>±</sup>	14.946	0,00
134	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$25 <sup>±</sup>	32.562	0,01
1	16.06.2023	Unum Group, Strike Price \$30 <sup>±</sup>	60	0,00
22	16.06.2023	Unum Group, Strike Price \$35 <sup>±</sup>	3.025	0,00
17	16.06.2023	Unum Group, Strike Price \$43 <sup>±</sup>	7.310	0,00
1.139	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$35 <sup>±</sup>	0	0,00
727	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$43 <sup>±</sup>	29.080	0,01
521	20.01.2023	Ventas Inc, Strike Price \$50 <sup>±</sup>	257.895	0,04
5	16.06.2023	VeriSign Inc, Strike Price \$140 <sup>±</sup>	975	0,00
5	16.06.2023	VeriSign Inc, Strike Price \$170 <sup>±</sup>	1.850	0,00
3	16.06.2023	VeriSign Inc, Strike Price \$200 <sup>±</sup>	3.705	0,00
63	16.06.2023	Viatis Inc, Strike Price \$11 <sup>±</sup>	6.143	0,00
12	16.06.2023	Viatis Inc, Strike Price \$8 <sup>±</sup>	210	0,00
90	16.06.2023	Viatis Inc, Strike Price \$9 <sup>±</sup>	2.700	0,00
2.700	21.04.2023	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$4 <sup>±</sup>	297.000	0,04
1.193	21.07.2023	Vishay Intertechnology Inc, Strike Price \$15 <sup>±</sup>	56.668	0,01
9	16.06.2023	Wabtec Corp, Strike Price \$85 <sup>±</sup>	2.183	0,00
73	17.03.2023	Wells Fargo & Co, Strike Price \$45 <sup>±</sup>	33.397	0,01
25	16.06.2023	Williams Companies Inc, Strike Price \$29 <sup>±</sup>	2.938	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 5,04 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
21	16.06.2023	Williams Companies Inc, Strike Price \$34 ±	6.615	0,00
5	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$45 ±	1.187	0,00
1	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$55 ±	640	0,00
3	21.04.2023	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$65 ±	4.020	0,00
60	20.01.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$50 ±	330	0,00
900	16.06.2023	ZTO Express Cayman Inc, Strike Price \$15 ±	0	0,00
1.232	16.06.2023	Zur Rose Group AG, Strike Price CHF18 ±	38.949	0,01
<b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: (40.050.640) US\$)</b>			<b>35.858.570</b>	<b>5,04</b>

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind BNP Paribas, Daiwa, Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Nomura International, SMBC Nikko Capital Markets Ltd und UBS AG.

### Differenzkontrakte 1,96 %

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(19.600)	10X Genomics Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.000)	1Life Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.700	3D Systems Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.914	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	455	0,00
3.900	3M Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.860)	3M Co	Morgan Stanley	0	0,00
(116)	4imprint Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	86	0,00
15.900	A10 Networks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	AAON Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	AAR Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
72.148	ABB Ltd	Goldman Sachs International	9.439	0,00
(1.400)	Abbott Laboratories	Goldman Sachs International	0	0,00
8.500	AbCellera Biologics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.800	Abercrombie & Fitch Co Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	ABM Industries Inc	Goldman Sachs International	3.324	0,00
53.758	abrdrn Plc	Bank of America Merrill Lynch	628	0,00
(2.100)	Academy Sports & Outdoors Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
40.400	Acadia Realty Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
109.052	Accelleron Industries AG	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Accenture Plc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
21.168	Accor SA	Société Générale	0	0,00
(17.100)	ACI Worldwide Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	Aclaris Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.400	Acuity Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.000)	Acushnet Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(23.668)	ACV Auctions Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
14.200	AdaptHealth Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
22.100	Adaptive Biotechnologies Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
14.100	Adecoagro SA	Goldman Sachs International	0	0,00
22.900	Adient Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.133	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.292	0,00
3.300	Adobe Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	ADT Inc	Goldman Sachs International	850	0,00
(7.000)	Adtalem Global Education Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	ADTRAN Inc	Goldman Sachs International	3.524	0,00
6.500	Advance Auto Parts Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.500	Advanced Drainage Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	Advanced Energy Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(885.117)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	AdvanSix Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Adventure Inc	Bank of America Merrill Lynch	483	0,00
83.991	AECOM	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Aeon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	239	0,00
2.300	AEON Financial Service Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48	0,00
5.000	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs International	0	0,00
46.949	AeroVironment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.500)	AES Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(32.777)	Affirm Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.400)	Aflac Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	AGC Inc	Bank of America Merrill Lynch	524	0,00
(2.200)	AGCO Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(21.700)	agilon health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Agilysys Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.900)	AGNC Investment Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.700)	Agree Realty Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
145.057.600	Aica Kogyo Co Ltd	Société Générale	71.654	0,01
(900)	Aica Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	92	0,00
3.100	Aiful Corp	Bank of America Merrill Lynch	210	0,00
600	Ain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	369	0,00
11.300	Air Lease Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
9.925	Air Liquide SA	Goldman Sachs International	2.057	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(2.300)	Air Products & Chemicals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
15.700	Air Transport Services Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Air Water Inc	Bank of America Merrill Lynch	306	0,00
6.300	Airbnb Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
36.502	Airbus SE	Goldman Sachs International	2.225	0,00
(108.191)	Airtel Africa Plc	Bank of America Merrill Lynch	7.403	0,00
9.540	AJ Bell Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.131	0,00
(700)	Ajinomoto Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.067	0,00
1.031.857	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs International	3.433	0,00
5.329	Akzo Nobel NV	Morgan Stanley	718	0,00
3.600	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.500)	Alaska Air Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.600	Albany International Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.138	Albemarle Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
600	Albertsons Cos Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.300)	Alcoa Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
12.300	Alexander & Baldwin Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	Alexandria Real Estate Equities Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
108.382	Alfa Laval AB	Morgan Stanley	7.827	0,00
(18.800)	Alight Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Align Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
16.700	Alignment Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Allegiant Travel Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.142)	Allegion Plc	Morgan Stanley	0	0,00
8.600	Allegion Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800	Allegro MicroSystems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.600)	ALLETE Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.200)	AllianceBernstein Holding LP	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Alliant Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
19.500	Allison Transmission Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.600)	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
48.520	Allstate Corp	Goldman Sachs International	1.927	0,00
4.200	Ally Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Alpha Metallurgical Resources Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.013)	Alphabet Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.700	Alphatec Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Alps Alpine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	402	0,00
(4.300)	Altair Engineering Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	Alteryx Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(5.900)	Altra Industrial Motion Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
38.500	Altus Power Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Amada Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	92	0,00
(4.565)	Amazon.com Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.300)	Ambarella Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(34.800)	Amcor Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Amdocs Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
2.000	Amedisys Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.000	Ameren Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.000)	Ameresco Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.199.974	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs International	8.023	0,00
6.300.000	American Airlines Group Inc	Société Générale	8.795	0,00
4.900	American Assets Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
46.500	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.400	American Electric Power Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.219)	American Equity Investment Life Holding Co	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	American Express Co	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	American Financial Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.100	American Homes 4 Rent Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.800)	American International Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	American States Water Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	American Tower Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.900)	Americold Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.600	Ameris Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	AMETEK Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.228	AMETEK Inc	Morgan Stanley	0	0,00
426.996	Amgen Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.200)	Amkor Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.000	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.900	Amphenol Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.377)	Amplitude Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
602.563	ams AG	Société Générale	0	0,00
(1.173.409)	ams AG	Bank of America Merrill Lynch	0	0,00
8.000.000	ams-OSRAM AG	Société Générale	709.689	0,11
2.400	Amylyx Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.167.282.300	ANA Holdings Inc	Société Générale	1.385.091	0,20

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
300	ANA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	54	0,00
(6.600)	Andersons Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(43.100)	Annaly Capital Management Inc	Goldman Sachs International	35.922	0,01
(200)	ANSYS Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.900)	Antero Midstream Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Antero Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
22.700	Anywhere Real Estate Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
16.486	AO Smith Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Aon Plc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.200	Aozora Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.447	0,00
(607)	AP Moller - Maersk A/S Class B	Morgan Stanley	9.553	0,00
(6.700)	APA Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(20.100)	Apartment Income REIT Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
36.460	Apellis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.100)	API Group Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Apogee Enterprises Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.700	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Apollo Global Management Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.400)	Apollo Medical Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Appfolio Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.100)	Appian Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.000)	Apple Hospitality REIT Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Applied Industrial Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.700)	Applied Materials Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	AppLovin Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	AptarGroup Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.403	Aptiv Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(22.500)	Aramark	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.400)	Arbor Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	ArcBest Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.030	ArcBest Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	Arch Capital Group Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.000)	Arch Resources Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.400)	Archer-Daniels-Midland Co	Goldman Sachs International	0	0,00
15.000	Archrock Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.400	Arconic Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(29.300)	Arcos Dorados Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Arcosa Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Ares Management Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Argo Group International Holdings Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
6.600	Arista Networks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.400	Armstrong World Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.600	Array Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Arthur J Gallagher & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
9.500	Artisan Partners Asset Management Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.200)	Arvinas Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	As One Corp	Bank of America Merrill Lynch	382	0,00
(600)	Asahi Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	106	0,00
(400)	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	19	0,00
(9.800)	Asana Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	Asbury Automotive Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.064	Ascential Plc	Bank of America Merrill Lynch	972	0,00
5.000	ASGN Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Ashland Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
49.910	Ashmore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	18.168	0,00
(1.889)	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.807	0,00
15.251	ASML Holding NV	Société Générale	0	0,00
(2.200)	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.400	Associated Banc-Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.713)	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.713	0,00
26.536	Assura Plc	Bank of America Merrill Lynch	8	0,00
100	Assurant Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.700)	Assured Guaranty Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Astec Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Astellas Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	163	0,00
(1.231.461)	AT&T Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	ATI Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Atkore Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Atlantic Union Bankshares Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
8.400	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Atlassian Corp Plc Class A	Goldman Sachs International	16.137	0,00
(3.000)	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	AtriCure Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.297)	Auction Technology Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.047	0,00
(77.232)	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.710	0,00
1.500	Autobacs Seven Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	160	0,00
5.500	Autodesk Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.244	Autoliv Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1.400)	AutoNation Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	AutoZone Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.700	AvalonBay Communities Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	Avangrid Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	Avanos Medical Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.500	Avantor Inc	Goldman Sachs International	625	0,00
(1.200)	Avery Dennison Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Avid Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.000)	AvidXchange Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Avient Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.600)	Avis Budget Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.500)	Avista Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.500)	Avnet Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.800	Axalta Coating Systems Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Axcelis Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.800	Axis Capital Holdings Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
44.531	Axon Enterprise Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Axonics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Axos Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.300)	Axsome Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.500)	AZEK Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.700)	Azenta Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	AZZ Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.100)	B Riley Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.800)	B&G Foods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.446)	Babcock International Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.588	0,00
(400)	Badger Meter Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.115	BAE Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.502	0,00
(344.800)	BAE Systems Plc	Goldman Sachs International	6.933	0,00
10.500	Baker Hughes Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(19.973)	Balanced Commercial Property Trust Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.163	0,00
1.900	Balchem Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.000	Ball Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
9.700	Bally's Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Banc of California Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	BancFirst Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Société Générale	100.773	0,01
1.500.000	Banco BPM SpA	Société Générale	109.384	0,02
(6.300)	Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
19.900	Bank of America Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(3.000)	Bank of Hawaii Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Bank of Kyoto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.798	0,00
26.900	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.600	Bank OZK	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	BankUnited Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Banner Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
81.325	Barclays Plc	Bank of America Merrill Lynch	712	0,00
(3.200)	Barnes Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(96.390)	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.006	0,00
(41.294)	BASF SE	Morgan Stanley	17.273	0,00
(10.935)	BASF SE	Société Générale	0	0,00
(9.600)	Bath & Body Works Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(29.700)	Bausch + Lomb Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.400	Bausch Health Cos Inc	Goldman Sachs International	1.717	0,00
(5.400)	Baxter International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	BayCurrent Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.607	0,00
(16.507)	Bayerische Motoren Werke AG	Morgan Stanley	11.834	0,00
(1.200)	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.400	Beauty Health Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.300)	Becton Dickinson & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.207)	Beiersdorf AG	Morgan Stanley	2.973	0,00
200	Belden Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	BellRing Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(746)	Bellway Plc	Bank of America Merrill Lynch	271	0,00
200	Benefit One Inc	Bank of America Merrill Lynch	64	0,00
(23.600)	Bentley Systems Inc Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.948)	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.126	0,00
(1.000)	Berkshire Hathaway Inc Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
4.700	Berkshire Hills Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Berry Global Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	Beyond Meat Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
31.200	BigCommerce Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Bill.com Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Biolife Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Bio-Rad Laboratories Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(900)	Bio-Techne Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
8.100	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.400)	Black Hills Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Black Knight Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(6.600)	Black Stone Minerals LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Blackbaud Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.500)	Blackline Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	BlackRock Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
17.500	Blackstone Mortgage Trust Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
6.900	Blackstone Secured Lending Fund	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.200)	Blackstone Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.100)	Blink Charging Co	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Block Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Bloom Energy Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
12.500	Bloomin' Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.300)	Blucora Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(36.300)	Blue Owl Capital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(102.203)	Bodycote Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.307)	Boeing Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.300)	Boise Cascade Co	Goldman Sachs International	0	0,00
400	BOK Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(40.589)	boohoo Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.083	0,00
(3.100)	Boot Barn Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
13.528	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(39.734)	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.700	BorgWarner Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Boston Beer Co Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Boston Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.000)	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.500)	Bowlero Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
10.400	Box Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
10.700	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
71.983	BP Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.585	0,00
(700)	Brady Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
25.600	Brandywine Realty Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.500)	Braze Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
600	Bread Financial Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(21.257)	Brenntag SE	Morgan Stanley	3.230	0,00
3.100	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.800)	Brighthouse Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.200	BrightSpire Capital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.000)	Brinker International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.000	Brink's Co	Goldman Sachs International	0	0,00
13.200	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(122)	Britvic Plc	Bank of America Merrill Lynch	45	0,00
(4.700)	Brixmor Property Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(287.063)	Broadcom Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.700)	Broadmark Realty Capital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	Broadstone Net Lease Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.700	Brookfield Renewable Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
13.900	Brown & Brown Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Brown-Forman Corp Class B	Goldman Sachs International	78	0,00
(5.900)	BRP Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Bruker Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Brunswick Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.300)	Buckle Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	Builders FirstSource Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.200)	Bumble Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.500)	Bunge Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.400	BWX Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.073)	Bytes Technology Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	53	0,00
200	C Uyemura & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	235	0,00
19.100	C3ai Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Cabot Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Cactus Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Cadence Bank	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.300	Caesars Entertainment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	Caleres Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.600	California Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	California Water Service Group	Goldman Sachs International	0	0,00
3.000	Calix Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Callon Petroleum Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.000)	Camden Property Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.000)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Camping World Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.400)	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs International	12	0,00
(3.219)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	Canadian Solar Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800	Cannae Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
59.300	Cano Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.300	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	958	0,00
9.300	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	Capitol Federal Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.900)	Capri Holdings Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
15.800	CareTrust REIT Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
53.467	Cargotec Oyj Class B	Morgan Stanley	6.677	0,00
(23.100)	Cargurus Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Carlisle Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.300)	Carlyle Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.800)	CarMax Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
638.754	Carnival Corp	Société Générale	0	0,00
(48.400)	Carnival Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.608)	Carnival Plc	Bank of America Merrill Lynch	15.147	0,00
8.500	Carpenter Technology Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	Carrier Global Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(35.821)	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.700	Cars.com Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	Carter's Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.200)	Carvana Co	Goldman Sachs International	0	0,00
1.700	Casella Waste Systems Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.400)	Cassava Sciences Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.000	Catalent Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.100)	Caterpillar Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Cathay General Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Cavco Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.900	CBIZ Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.500)	CBRE Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
8.300	CCC Intelligent Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.900	CDW Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800.000	Cellnex Telecom SA	Société Générale	726.177	0,11
(900)	Celsius Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(215.649)	Centene Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
10.600	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.400	Centerspace	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Central Garden & Pet Co Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Central Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	1.478	0,00
105.958	Centrica Plc	Bank of America Merrill Lynch	12.433	0,00
(3.800)	Century Communities Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
263.949	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs International	1.240	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(13.100)	Certara Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.457	CF Industries Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.000	ChampionX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Change Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.358	0,00
(41.500)	ChargePoint Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
35.930	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Chart Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.238)	Charter Communications Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Check Point Software Technologies Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Cheesecake Factory Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Chefs' Warehouse Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
26.400	Chegg Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	Chemours Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.678)	Chemring Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.324	0,00
4.900	Chesapeake Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Chesapeake Utilities Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.475)	Chevron Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Chewy Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(25.400)	Chimera Investment Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.200)	Chiyoda Corp	Bank of America Merrill Lynch	41	0,00
500	Choice Hotels International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.181	Chord Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Chubb Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	616	0,00
5.400	Chugin Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.943	0,00
14.700	Chugoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.116	0,00
(400)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Churchill Downs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.243	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs International	997	0,00
16.407	Cie Financiere Richemont SA Class A	Société Générale	0	0,00
(14.100)	Ciena Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.332.363	Cigna Corp	Goldman Sachs International	287.485	0,05
(5.200)	Cincinnati Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	CinCor Pharma Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
31.300	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Cintas Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Cirrus Logic Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
59.356	Cisco Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(13.800)	Citigroup Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.500)	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	City Holding Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.500)	Civitas Resources Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	CKD Corp	Bank of America Merrill Lynch	95	0,00
15.287	Clariant AG	Goldman Sachs International	575	0,00
(22.400)	Clarivate Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.100)	Claros Mortgage Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
20.200	Clean Energy Fuels Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	Clean Harbors Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Clear Secure Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	Clearfield Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.800)	Clearwater Analytics Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	Clearway Energy Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(319.511)	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Clorox Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.006)	Close Brothers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	223	0,00
4.400	Cloudflare Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
10.300	CME Group Inc Class A	Goldman Sachs International	2.216	0,00
5.500	CMS Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.600	CNA Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
15.100	CNH Industrial NV	Goldman Sachs International	0	0,00
8.800	CNO Financial Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	CNX Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
92.836	Coca-Cola Co	Goldman Sachs International	0	0,00
9.900	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.400	Cognex Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
73.047	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.900)	Cohen & Steers Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.263	Coherent Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
11.900	Cohu Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
40.750	Colgate-Palmolive Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.800)	Columbia Banking System Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.400)	Columbia Sportswear Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.300)	Comcast Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Comerica Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Comfort Systems USA Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.930)	Commerce Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Commercial Metals Co	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(2.200)	CommScope Holding Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.700)	Community Bank System Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	CommVault Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.385	Compass Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.573	0,00
(15.027)	Compass Group Plc	Goldman Sachs International	1.339	0,00
2.800	Compass Minerals International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.503)	Computacenter Plc	Bank of America Merrill Lynch	916	0,00
34.100	Comstock Resources Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	Comture Corp	Bank of America Merrill Lynch	772	0,00
3.000	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.700)	Concentrix Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.200)	Confluent Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.600)	CONMED Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.100)	ConocoPhillips	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.600)	Consensus Cloud Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Constellation Brands Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
6.600	Constellation Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
13.100	Constellium SE	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.400)	Construction Partners Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(46.609)	Continental AG	Morgan Stanley	14.369	0,00
(2.300)	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.000)	Copa Holdings SA Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Copart Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.100	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Core & Main Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.000)	Core Laboratories NV	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	CoreCivic Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.300)	Corning Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.700)	Corporate Office Properties Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
3.200	Corsair Gaming Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.800	Corteva Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	CorVel Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	369	0,00
24.700	Costamare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.315	CoStar Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
123.774	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.000)	Coterra Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
71.500	Coty Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	Coupa Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
69.000	Coupage Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.800	Coursera Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(40.800)	Cousins Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.800)	Cowen Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	CRA International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.700	Crane Holdings Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(519)	Cranswick Plc	Bank of America Merrill Lynch	745	0,00
1.400	Create Restaurants Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7	0,00
3.900	Credicorp Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(900)	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.687.757	Credit Agricole SA	Société Générale	4.679	0,00
500	Credit Saison Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	64	0,00
(14.200)	Credo Technology Group Holding Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
1.329	Crest Nicholson Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	79	0,00
(4.200)	Crestwood Equity Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Crocs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(947)	Croda International Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.761	0,00
(12.700)	Cross Country Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.400	Crowdstrike Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.600	Crown Castle Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.100)	Crown Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.664	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.600	CryoPort Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	CSG Systems International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	CSW Industrials Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.200	CSX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
300	CTS Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	CubeSmart	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Cullen/Frost Bankers Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.025	Cummins Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(33.400)	Cushman & Wakefield Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	Customers Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.100)	Cutera Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.100)	CVB Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
500	CVR Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	CVR Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.259)	CVS Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.252	0,00
(110.351)	CVS Health Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
104.668.230	CyberAgent Inc	Société Générale	0	0,00
1.000	CyberArk Software Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
5.500	Cytek Biosciences Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23	0,00
(300)	Daihen Corp	Bank of America Merrill Lynch	171	0,00
100	Daikin Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	472	0,00
900	Daiwabo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	355	0,00
10.700	Dana Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Danaher Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Danaos Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.401	Daqo New Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
16.480	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(42)	Darktrace Plc	Bank of America Merrill Lynch	1	0,00
8.100	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.000	Datadog Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Dave & Buster's Entertainment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	DaVita Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.300	DCM Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	464	0,00
(4.200)	DCP Midstream LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(632)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	823	0,00
(1.000)	Deckers Outdoor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.849	Deere & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.100)	Definitive Healthcare Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
11.500	Delek US Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.660)	Deliveroo Plc	Bank of America Merrill Lynch	373	0,00
(15.300)	Dell Technologies Inc Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
10.661	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.800)	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	DeNA Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	314	0,00
(600)	Denbury Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.137	Denbury Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.100)	Dentsply Sirona Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Dentsu Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	37	0,00
(2.275)	Derwent London Plc	Bank of America Merrill Lynch	693	0,00
400	Descente Ltd	Bank of America Merrill Lynch	160	0,00
11.500	Designer Brands Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
9.275.878	Deutsche Lufthansa AG	UBS AG	1.347.296	0,20
600.723	Deutsche Telekom AG	Société Générale	0	0,00
1.049	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
18.700	DexCom Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
30.500	DHT Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.300)	Diamond Offshore Drilling Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(17.400)	DiamondRock Hospitality Co	Goldman Sachs International	0	0,00
5.329.844	DiaSorin SpA	Société Générale	576.709	0,09
(7.100)	DICE Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Dick's Sporting Goods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.300)	Digi International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.500)	Digital Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(22.400)	Digital Turbine Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.350	DigitalBridge Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
16.400	DigitalOcean Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Dillard's Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.600)	Dime Community Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Diodes Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Dip Corp	Bank of America Merrill Lynch	167	0,00
(1.162)	Diploma Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.556	0,00
21.186	Direct Line Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.468	0,00
4.600	Discover Financial Services	Goldman Sachs International	0	0,00
(448)	DiscoverIE Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	134	0,00
262.821	DISH Network Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(26.986)	Diversified Energy Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.295	0,00
(28.200)	Dlocal Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.000)	DMG Mori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	542	0,00
(40.300)	DocGo Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.800	DocuSign Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.800)	Dolby Laboratories Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(144.855)	Dollar General Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.277.232)	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.400	Dominion Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.893	Domino's Pizza Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.250	0,00
2.200	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Donaldson Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.400)	Donnelley Financial Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.900)	DoorDash Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	Dorman Products Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
13.000	DoubleVerify Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	Dover Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	Dow Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
7.061	Dow Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Doximity Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.400)	DR Horton Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(29.454)	Dr Martens Plc	Bank of America Merrill Lynch	9.988	0,00
(1.747)	Draegerwerk AG & Co KGaA	Morgan Stanley	207	0,00
(2.500)	DraftKings Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	3.628	0,00
41.800	DraftKings Inc Class A	Goldman Sachs International	448	0,00
17.700	Driven Brands Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
31.300	Dropbox Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.096)	DS Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	964	0,00
(300)	DT Midstream Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	DTE Energy Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.000)	Duck Creek Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Duckhorn Portfolio Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
530.455	Dufry AG	Société Générale	0	0,00
9.000.000	Dufry One BV	Société Générale	1.358.676	0,20
(8.500)	Duke Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.900)	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	Duolingo Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
17.990	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.000)	Dutch Bros Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.500)	DXC Technology Co	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Dycom Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.800	Dynatrace Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.072)	E.ON SE	Société Générale	0	0,00
(222.769)	E.ON SE	Morgan Stanley	11.010	0,00
(40.400)	E2open Parent Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.000)	Eagle Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	Eagle Materials Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Earth Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.598	0,00
11.000	Earthstone Energy Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
800	East Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	381	0,00
(100)	East West Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Easterly Government Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
19.200	Eastern Bankshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.300	EastGroup Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(99.263)	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(642.458)	easyJet Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.653	0,00
(2.000)	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Ebara Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.063	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
4.300	eBay Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	Ecolab Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
82.600	Ecovyst Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(19.937)	Edenred	Société Générale	0	0,00
4.600	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Edison International	Goldman Sachs International	0	0,00
20.200	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
100	eGuarantee Inc	Bank of America Merrill Lynch	168	0,00
(24.600)	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.900	Elastic NV	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Elecom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	208	0,00
1.100	Electric Power Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	558	0,00
(3.000)	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Element Solutions Inc	Goldman Sachs International	174	0,00
(400)	Elevance Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	elf Beauty Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.400	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.000)	Ellington Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.000.000	ELM BV for Swiss Re Ltd	Société Générale	340.235	0,06
1.400	Elme Communities	Goldman Sachs International	0	0,00
13.500	Embecta Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	EMCOR Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(20.367)	Emerson Electric Co	Goldman Sachs International	0	0,00
13.900	Empire State Realty Trust Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Encompass Health Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.700)	Encore Capital Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.300)	Encore Wire Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.400)	Endeavor Group Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.012)	Energiean Plc	Bank of America Merrill Lynch	10.074	0,00
(4.300)	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Energy Recovery Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
66.300	Energy Transfer LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(33.300)	Energy Vault Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Enerpac Tool Group Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	EnerSys	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	EngageSmart Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
20.440	Eni SpA	Société Générale	0	0,00
(12.200)	EnLink Midstream LLC	Goldman Sachs International	0	0,00
3.000	Enova International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.600)	Enovix Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
5.382	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.900)	EnPro Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Ensign Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
525	Entegris Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.200	Entergy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.600)	Enterprise Financial Services Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.000)	Enterprise Products Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
66.770	Investnet Inc	Société Générale	0	0,00
(3.400)	Investnet Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	EOG Resources Inc	Goldman Sachs International	28.302	0,00
1.000	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.800)	ePlus Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.400	EPR Properties	Goldman Sachs International	0	0,00
17.500	EQT Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Equifax Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Equinix Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.700	Equitable Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
124.600	Equitrans Midstream Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.600)	Equity Commonwealth	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.900)	Equity LifeStyle Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.600	Equity Residential	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.500)	Erie Indemnity Co Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.400)	ESAB Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	ESCO Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	Essent Group Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.900)	Essential Properties Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Essential Utilities Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Essex Property Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.900)	Establishment Labs Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.500	Etsy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.400)	Euronet Worldwide Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.400	Everbridge Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.000)	Evercore Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Everest Re Group Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
10.200	Evergy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
16.900	Everi Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Eversource Energy	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
3.800	EVERTEC Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.900)	Evo Payments Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.800)	Evolent Health Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(100.987)	Evonik Industries AG	Morgan Stanley	12.554	0,00
2.000	Evoqua Water Technologies Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.600)	Exelon Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	ExlService Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
29.000	eXp World Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.504.600	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	13.093	0,00
(7.700)	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.500)	Expensify Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(917)	Experian Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.659	0,00
2.100	Exponent Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.458)	Expro Group Holdings NV	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Extra Space Storage Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
19.000	Extreme Networks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.661)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.700	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(217)	F&G Annuities & Life Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	F5 Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Fabrinet	Goldman Sachs International	0	0,00
77.241	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
43.655.689	Fancl Corp	Société Générale	0	0,00
1.300	Fancl Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.125	0,00
12.100	Fastenal Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(31.889)	Fastenal Co	Morgan Stanley	0	0,00
3.100	FB Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.400)	Federal Realty Investment Trust	Goldman Sachs International	809	0,00
1.700	Federal Signal Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.400	Federated Hermes Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
31.330	FedEx Corp	Goldman Sachs International	3.588	0,00
14.229	Ferguson Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.949	Ferrari NV	Société Générale	0	0,00
(10.900)	Ferroglobe Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.008	Fevertree Drinks Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.470	0,00
(5.100)	Fidelity National Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Figs Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(19.400)	First Advantage Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.700)	First American Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
10.300	First BanCorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	First Citizens BancShares Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
11.100	First Commonwealth Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.400	First Financial Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
9.100	First Financial Bankshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.300)	First Foundation Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.200)	First Hawaiian Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.600)	First Horizon Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800	First Industrial Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.700	First Interstate BancSystem Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	First Merchants Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.600)	First Republic Bank	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	First Solar Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	FirstCash Holdings Inc	Goldman Sachs International	6.795	0,00
(12.200)	FirstEnergy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.900	Fiserv Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(38.700)	Fisker Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Five Below Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.800)	Five9 Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	Fiverr International Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.600	Flex Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
10.700	Flowers Foods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Flowserve Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
78.754	FLSmidth & Co A/S	Morgan Stanley	1.365	0,00
(29.935)	Fluence Energy Inc	Goldman Sachs International	642	0,00
32.884	Fluor Corp	Goldman Sachs International	2.263	0,00
(97)	Flutter Entertainment Plc	Bank of America Merrill Lynch	281	0,00
(4.300)	FMC Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	FNB Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.400)	Focus Financial Partners Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Food & Life Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.018	0,00
8.900	Foot Locker Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.487.070	Ford Motor Co	Bank of America Merrill Lynch	5.698	0,00
(900)	FormFactor Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
26.800	Fortinet Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.467	Fortive Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
84.836	Fortum OYJ	Morgan Stanley	1.631	0,00
13.246	Fortune Brands Innovations Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Forward Air Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Four Corners Property Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.100	Fox Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
7.200	Fox Corp Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
100	FP Corp	Bank of America Merrill Lynch	286	0,00
(8.800)	Franchise Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.900	Franklin BSP Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	Franklin Electric Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(22.500)	Franklin Resources Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
27.038	Freeport-McMoRan Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.414)	Fresenius SE & Co KGaA	Société Générale	0	0,00
5.600	Fresh Del Monte Produce Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.700)	Freshpet Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.100)	Freshworks Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.900)	FREYR Battery SA	Goldman Sachs International	0	0,00
18.000	Frontdoor Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Frontier Communications Parent Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.800	Frontier Group Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.000)	Frontline Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
9.300	FS KKR Capital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
49.827	FTI Consulting Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Fuji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	617	0,00
600	Fuji Corp	Bank of America Merrill Lynch	208	0,00
2.300	Fuji Oil Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.951	0,00
300	Fujikura Ltd	Bank of America Merrill Lynch	37	0,00
(600)	Fujimi Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.368	0,00
500	Fujitsu General Ltd	Bank of America Merrill Lynch	497	0,00
(100)	Fujitsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	189	0,00
(300)	Fukuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	11	0,00
300	Fukuyama Transporting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	182	0,00
1.700	Fulgent Genetics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	FULLCAST Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	82	0,00
22.000	Fulton Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.700)	Funko Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Furukawa Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	320	0,00
(1.300)	Fuso Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	72	0,00
(3.870)	Future Plc	Bank of America Merrill Lynch	6.661	0,00
100	Fuyo General Lease Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	85	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.000	Gaming & Leisure Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Gap Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Garmin Ltd	Goldman Sachs International	73	0,00
2.700	Gartner Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.000	Gates Industrial Corp Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	GATX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.012	Gaztransport Et Technigaz SA	Goldman Sachs International	162	0,00
(62.600)	Gen Digital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.400)	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.100	General Electric Co	Goldman Sachs International	0	0,00
112.547	General Mills Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.675)	General Motors Co	Morgan Stanley	0	0,00
34.600	General Motors Co	Goldman Sachs International	0	0,00
30.900	Genesis Energy LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	Genpact Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.900)	Gentex Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	Gentherm Inc	Goldman Sachs International	883	0,00
500	Genuine Parts Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.301)	Genuit Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	23	0,00
(25.700)	Genworth Financial Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(20.800)	GEO Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.083)	Gerresheimer AG	Morgan Stanley	1.011	0,00
(9.900)	Getty Realty Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	Gibraltar Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.100)	G-III Apparel Group Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.300)	Gitlab Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(230)	Givaudan SA	Goldman Sachs International	219	0,00
7.000	Glacier Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Glaukos Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800.000	Glencore Funding LLC	Société Générale	107.343	0,02
1.271.394	Glencore Plc	Société Générale	0	0,00
11.600	Global Net Lease Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Global Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Global Payments Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.200)	Global-e Online Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.400)	GLOBALFOUNDRIES Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Globant SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Globe Life Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Globus Medical Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
600	Glory Ltd	Bank of America Merrill Lynch	196	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
300	GMO internet group Inc	Bank of America Merrill Lynch	51	0,00
43.676.000	GMO Payment Gateway Inc	Société Générale	0	0,00
(1.000)	GMS Inc	Goldman Sachs International	4.573	0,00
7.200	GoDaddy Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.600)	Gogo Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Golar LNG Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
7.400	Golden Entertainment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(31.300)	Golden Ocean Group Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
695.031	Goldman Sachs Group Inc	Société Générale	0	0,00
3.600	Goosehead Insurance Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
14.800	Graco Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	GrafTech International Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Grand Canyon Education Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.100	Granite Construction Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
13.100	Graphic Packaging Holding Co	Goldman Sachs International	0	0,00
21.500	Gray Television Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.500)	Great Portland Estates Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.320	0,00
(6.700)	Green Brick Partners Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.000	Green Dot Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Green Plains Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	Greenbrier Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Greif Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Grid Dynamics Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	Griffon Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
11.600	Grocery Outlet Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Group 1 Automotive Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800.000	Groupe Bruxelles Lambert NV	Société Générale	46.959	0,01
600	GS Yuasa Corp	Bank of America Merrill Lynch	469	0,00
139.477	Guardant Health Inc	Goldman Sachs International	2.204	0,00
(5.200)	Guess? Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.600)	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Gulfport Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.600)	GXO Logistics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.500	H&E Equipment Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(228.898)	H&R Block Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	H.U. Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	96	0,00
3.200	H2O Retailing Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.962	0,00
5.000	Hachijuni Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.006	0,00
6.000	Haemonetics Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
14.300	Hain Celestial Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(19.600)	Halliburton Co	Goldman Sachs International	0	0,00
7.700	Hamilton Lane Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
65.626	Hammerson Plc	Bank of America Merrill Lynch	16	0,00
(200)	Hancock Whitney Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(48.000)	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Hanwa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	657	0,00
(4.757)	Harbour Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	468	0,00
14.736	Hargreaves Lansdown Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.926	0,00
800	Harmonic Drive Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	865	0,00
(8.500)	Harmonic Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.600)	Harmony Biosciences Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.200	Hartford Financial Services Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Hasbro Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Haseko Corp	Bank of America Merrill Lynch	496	0,00
(5.800)	HashiCorp Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Hawaiian Electric Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
260.615	Hays Plc	Bank of America Merrill Lynch	793	0,00
(49.500)	Hayward Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	Hazama Ando Corp	Bank of America Merrill Lynch	597	0,00
(1.700)	HB Fuller Co	Goldman Sachs International	0	0,00
94.084	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.600)	Healthcare Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	43.187	0,01
8.500	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.100	HealthEquity Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.500	Healthpeak Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
26.700	Heartland Express Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.000	Heartland Financial USA Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Heico Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Heico Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.968)	HeidelbergCement AG	Morgan Stanley	4.764	0,00
(1.100)	Heiwa Real Estate Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.356	0,00
1.400	Heiwado Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.928	0,00
500	Helen of Troy Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.200)	Helios Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
38.700	Helix Energy Solutions Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.100	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	Henry Schein Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.761.878	Herbalife Nutrition Ltd	Société Générale	263.835	0,05
45.267	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs International	101.979	0,01



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
600	Herc Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.800	Heritage Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Hershey Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.600)	Hertz Global Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Heska Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Hess Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.800)	Hess Midstream LP Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.200)	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs International	30.520	0,00
100.323	Hexagon AB Class B	Morgan Stanley	3.951	0,00
(14.607)	Hexcel Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
6.500	HF Sinclair Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Hibbett Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.400	Hiday Hidaka Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.514	0,00
(10.500)	Highwoods Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(893)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	325	0,00
3.200	Hillenbrand Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.500	Hillman Solutions Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.300)	Hilltop Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Hilton Grand Vacations Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.500	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(36.900)	Hims & Hers Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	HIS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	89	0,00
(1.200)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	367	0,00
1.100	Hitachi Zosen Corp	Bank of America Merrill Lynch	78	0,00
4.000	HNI Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.400	Hokuhoku Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	598	0,00
(14.340)	Holcim Ltd	Société Générale	0	0,00
(21.500)	Hollysys Automation Technologies Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
7.700	Hologic Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.600	Home BancShares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Home Depot Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	245	0,00
(5.500)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Hope Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.500	Horace Mann Educators Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Horiba Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.021	0,00
5.400	Hormel Foods Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
15.730.000	Hosiden Corp	Société Générale	0	0,00
400	Hosiden Corp	Bank of America Merrill Lynch	30	0,00
(38.600)	Host Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
24.000	Hostess Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Houlihan Lokey Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	House Foods Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	564	0,00
76.190	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.900)	HP Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
88.000	HSBC Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	51.339	0,01
(400)	Hub Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.410)	Hubbell Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	Hubbell Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	HubSpot Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
19.600	Hudson Pacific Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.800)	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.626	0,00
500	Humana Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(22.500)	Huntington Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.400	Huntington Ingalls Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.463)	Huntsman Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Huron Consulting Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.400	Hyatt Hotels Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	IAA Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	IAC Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
28.562	Ibstock Plc	Bank of America Merrill Lynch	806	0,00
(3.000)	Icahn Enterprises LP	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	ICF International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.500)	ICU Medical Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	IDEX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.500	IDOM Inc	Bank of America Merrill Lynch	58	0,00
1.550.748	Idorsia Ltd	Société Générale	102.586	0,01
100	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12	0,00
(5.080)	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Illumina Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.000)	IMAX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
90.446	IMI Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.470	0,00
500	Impinj Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Inari Medical Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(38.345)	Inchcape Plc	Goldman Sachs International	1.530	0,00
(24.400)	Independence Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Independent Bank Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Independent Bank Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	indie Semiconductor Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
2.503	Indivior Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.647	0,00
(14.275)	Industria de Diseno Textil SA	Morgan Stanley	564	0,00
10.700	Infinera Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.080)	Informa Plc	Bank of America Merrill Lynch	640	0,00
500	Informatica Inc Class A	Goldman Sachs International	140	0,00
16.595	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.600	Ingevity Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.200)	Ingles Markets Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Ingredion Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.400	Inmode Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.400)	Innospec Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.300	Innovative Industrial Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.000)	Innoviva Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Inpex Corp	Bank of America Merrill Lynch	10	0,00
(2.100)	Insight Enterprises Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Insource Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1	0,00
2.700	Insperity Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.500)	Inspire Medical Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.300	Installed Building Products Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.000)	Instructure Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
624.288	Insulet Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Integer Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800	Integra LifeSciences Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
63.900	Intel Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.600	Interactive Brokers Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(118)	InterContinental Hotels Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	248	0,00
(10.400)	InterDigital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.778)	Intermediate Capital Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.334	0,00
(1.500)	International Bancshares Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.205)	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.214.989)	International Consolidated Airlines Group SA	Goldman Sachs International	9.677	0,00
3.776.042	International Consolidated Airlines Group SA	Société Générale	709.011	0,11
(11.400)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.300)	International Game Technology Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.600)	International Money Express Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.800	International Paper Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.200)	International Seaways Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.831	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1.356)	Intertek Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.112	0,00
(6.637)	Intesa Sanpaolo SpA	Société Générale	0	0,00
2.800	Intra-Cellular Therapies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	Intuit Inc	Goldman Sachs International	13.077	0,00
5.900	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	InvenTrust Properties Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Invesco Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
5.534	Investec Plc	Bank of America Merrill Lynch	885	0,00
29.800	Invitation Homes Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(53.900)	IonQ Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.900	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	Iridium Communications Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Iriso Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	111	0,00
(1.600)	iRobot Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.100)	Iron Mountain Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(17.780)	ISS A/S	Morgan Stanley	667	0,00
(33.600)	iStar Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.408	0,00
(1.100)	Itron Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
51.369	ITT Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.682)	ITV Plc	Bank of America Merrill Lynch	18	0,00
200	Izumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	89	0,00
600	J & J Snack Foods Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
36.216	J M Smucker Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(93.780)	J Sainsbury Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.559	0,00
8.300	J Trust Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	235	0,00
(3.500)	Jabil Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Jack Henry & Associates Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.700	Jack in the Box Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	Jacobs Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	JAFCO Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19	0,00
(800)	Jamf Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Japan Material Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	268	0,00
100	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2	0,00
3.500	Japan Post Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	265	0,00
3.500	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.537	0,00
(2.100)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1.200)	JB Hunt Transport Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.700	JBG SMITH Properties	Goldman Sachs International	0	0,00
2.600	Jefferies Financial Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
13.700	JELD-WEN Holding Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
95.600	JetBlue Airways Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.300	JFrog Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.400)	JM Smucker Co	Goldman Sachs International	0	0,00
1.400	John Bean Technologies Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	John Wiley & Sons Inc Class A	Goldman Sachs International	40.916	0,01
187.715	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	378	0,00
(13.500)	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
22.077	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(15.017)	Johnson Matthey Plc	Goldman Sachs International	2.349	0,00
540	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	408	0,00
(1.300)	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.000)	JPMorgan Chase & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	JSR Corp	Bank of America Merrill Lynch	11	0,00
(787)	JTC Plc	Bank of America Merrill Lynch	251	0,00
(200)	JTOWER Inc	Bank of America Merrill Lynch	892	0,00
(10.200)	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.989	Jupiter Fund Management Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.465	0,00
(386.701)	Just Eat Takeaway.com NV	Société Générale	0	0,00
100	Kadant Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Kaga Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	310	0,00
3.600	Kaiser Aluminum Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
600	Kamigumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	174	0,00
900	Kaneka Corp	Bank of America Merrill Lynch	4	0,00
600	KAO Corp	Bank of America Merrill Lynch	825	0,00
1.000	KAR Auction Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.400)	KB Home	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.900)	KBR Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.022	0,00
1.300	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.118	0,00
4.500	Keikyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.245	0,00
(100)	Keio Corp	Bank of America Merrill Lynch	71	0,00
(5.400)	Kellogg Co	Goldman Sachs International	0	0,00
5.600	Kemper Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(46.078)	Kennametal Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(23.300)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
23.300	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(150.374)	KeyCorp	Goldman Sachs International	0	0,00
78.062	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(197)	Keywords Studios Plc	Bank of America Merrill Lynch	121	0,00
(2.400)	Kforce Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.100	Kilroy Realty Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.300)	Kimbell Royalty Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
93.256	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs International	1.546	0,00
11.900	Kimco Realty Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.000	Kinden Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.199	0,00
11.300	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Kinetik Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(37.157)	KION Group AG	Morgan Stanley	6.459	0,00
9.900	Kirby Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
15.700	Kite Realty Group Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
4.300	KKR & Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
13.800	KKR Real Estate Finance Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	KLA Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.795	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.341)	Knorr-Bremse AG	Morgan Stanley	3.802	0,00
(5.400)	KnowBe4 Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.400)	Knowles Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	497	0,00
51.172.182	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Société Générale	0	0,00
19.100	Kohl's Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Komatsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	254	0,00
500	Konami Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	159	0,00
(2.500)	Konica Minolta Inc	Bank of America Merrill Lynch	244	0,00
6.823	Koninklijke DSM NV	Société Générale	0	0,00
5.752	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	2.536	0,00
(6.500)	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	2.536	0,00
(6.500)	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	2.536	0,00
(6.500)	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	2.536	0,00
(2.600)	Korn Ferry	Goldman Sachs International	0	0,00
6.200	Kornit Digital Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Kose Corp	Bank of America Merrill Lynch	690	0,00
7.100	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
48.453	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs International	2.661	0,00
18.200	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.700)	Krispy Kreme Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.216	Kroger Co	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.600	K's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	636	0,00
(1.900)	Kulicke & Soffa Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18	0,00
(2.300)	Kuraray Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	278	0,00
25.400	Kyndryl Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Kyocera Corp	Bank of America Merrill Lynch	290	0,00
588.726.099	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Société Générale	0	0,00
800	Kyowa Kirin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	91	0,00
5.300	Kyushu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.466	0,00
(6.946)	L3Harris Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.500	L3Harris Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Laboratory Corp of America Holdings	Goldman Sachs International	0	0,00
28.300	Ladder Capital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Lam Research Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Lamar Advertising Co Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Lancaster Colony Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(373)	Land Securities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	15	0,00
(2.000)	Landstar System Inc	Goldman Sachs International	4.605	0,00
6.000	Lantheus Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(790)	Laredo Petroleum Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(40.900)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.900	Lattice Semiconductor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
26.330	Laureate Education Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	Lazard Ltd Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800	La-Z-Boy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.600)	LCI Industries	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.524)	Lear Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.000	Lear Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
45.100	Legalzoom.com Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.800	Leggett & Platt Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(900)	Leidos Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.192	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.600)	Lemonade Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	LendingClub Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Lennar Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	Lennar Corp Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
6.464	Lennox International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(163.918)	Leonardo SpA	Goldman Sachs International	500	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
800	Leopalace21 Corp	Bank of America Merrill Lynch	64	0,00
(24.900)	Leslie's Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Levi Strauss & Co Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.000)	LGI Homes Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.800)	LHC Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.500)	Liberty Broadband Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.600)	Liberty Broadband Corp Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
7.900	Liberty Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.000	Liberty Global Plc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
11.400	Liberty Global Plc Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
45.800	Liberty Latin America Ltd Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	Liberty Media Corp-Liberty Formula One Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
9.300	Liberty Media Corp-Liberty Formula One Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
7.600	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
13.200	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
(56.800)	Li-Cycle Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Life Storage Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Ligand Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(82.503)	Lightwave Logic Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	Lincoln Electric Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
27.500	Lincoln National Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	Linde Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.815)	Linde Plc	Morgan Stanley	8.856	0,00
(1.100)	Lindsay Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.400	Lion Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.916	0,00
65.700	Lions Gate Entertainment Corp Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
2.992	Liontrust Asset Management Plc	Bank of America Merrill Lynch	916	0,00
(12.561)	Lithia Motors Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Littelfuse Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.500)	LivaNova Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Live Nation Entertainment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Live Oak Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.200	Livent Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.900	LivePerson Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.200)	LiveRamp Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	LKQ Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.328)	Lockheed Martin Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.900	Loews Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.232)	London Stock Exchange Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	17.114	0,00
(3.783)	LondonMetric Property Plc	Bank of America Merrill Lynch	107	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(4.076)	Lonza Group AG	Société Générale	0	0,00
23.542	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.452	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.500	LPL Financial Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.300	LSB Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	LTC Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(130.900)	Lucid Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.200	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
51.402	Lumen Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.733.145	Luminar Technologies Inc	Goldman Sachs International	8.520	0,00
16.970	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Société Générale	0	0,00
(17.900)	LXP Industrial Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
348.656	Lyft Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.675)	LyondellBasell Industries NV Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(472.821)	LyondellBasell Industries NV Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
38.505	M&T Bank Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.500)	M/I Homes Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
20.300	Macerich Co	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Macnica Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	74	0,00
4.800	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Macy's Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Madison Square Garden Entertainment Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Madison Square Garden Sports Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.200)	Magellan Midstream Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
12.500	Magnite Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.000)	Magnolia Oil & Gas Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.800)	MakeMyTrip Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	Malibu Boats Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.557)	Man Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.331	0,00
4.500	Mandom Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.437	0,00
(700)	Manhattan Associates Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	ManpowerGroup Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(40.200)	Marathon Digital Holdings Inc	Goldman Sachs International	44	0,00
31.251	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(30.050)	Marks & Spencer Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	68	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(38.200)	Marqeta Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.900	Marriott International Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
974.542	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs International	6.373	0,00
6.800	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Martin Marietta Materials Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Maruha Nichiro Corp	Bank of America Merrill Lynch	798	0,00
2.000	Marui Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	352	0,00
(39.900)	Marvell Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(35.312)	Masco Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Masimo Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Masonite International Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	MasTec Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.100	Masterbrand Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.600	Mastercard Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Matador Resources Co	Goldman Sachs International	0	0,00
1.274.180	Match Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Materion Corp	Goldman Sachs International	458	0,00
2.400	Matson Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.000	Mattel Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.200	Maxar Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Maxeon Solar Technologies Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	Maximus Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Mazda Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	282	0,00
(5.600)	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(224.275)	McDonald's Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
500	McGrath RentCorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	McKesson Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.300	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	MDU Resources Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800	Mebuki Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	159	0,00
(32.600)	Medical Properties Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Medifast Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.400	Medipal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.149	0,00
2.300	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.200	Medtronic Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Meiko Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.011	0,00
3.800.000	Meituan	Société Générale	212.439	0,04
(92.805)	Meituan Class B	Société Générale	0	0,00
34.434.800	Menicon Co Ltd	Société Générale	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(1.000)	Menicon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	460	0,00
700	MercadoLibre Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Mercer International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.800)	Merck & Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.300	Mercury General Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Mercury Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.400)	Meridian Bioscience Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	Merit Medical Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.400)	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Mesa Laboratories Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Methode Electronics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	MetLife Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
148.156	Metso Outotec OYJ	Morgan Stanley	1.228	0,00
1.061.972	Meyer Burger Technology AG	Goldman Sachs International	2.049	0,00
(1.100)	MFA Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	MGE Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	MGIC Investment Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
8.200	MGM Resorts International	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	MGP Ingredients Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.892	Micro Focus International Plc	Bank of America Merrill Lynch	21.107	0,00
(1.148.458)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.400)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(135.411)	Microsoft Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Mid-America Apartment Communities Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.325.412)	Middleby Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Middlesex Water Co	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Milbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	615	0,00
(5.200)	MillerKnoll Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	MINEBEA MITSUMI Inc	Bank of America Merrill Lynch	700	0,00
(5.800)	Minerals Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.300)	Mister Car Wash Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.531)	Mitie Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	665	0,00
1.100	Mitsubishi Chemical Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	7	0,00
700	Mitsubishi Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.228	0,00
(2.400)	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	210	0,00
(800)	Mitsubishi Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	358	0,00
300	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	27	0,00
(100)	Miura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	32	0,00
2.500	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.849	0,00
(1.808)	MKS Instruments Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(200)	Model N Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.300)	Modine Manufacturing Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	ModivCare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Moelis & Co Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Mohawk Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
15.019	Molson Coors Beverage Co Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
5.236	Molten Ventures Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.988	0,00
29.500	Momentive Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Monarch Casino & Resort Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.900)	Monday.com Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
103.333	Mondelez International Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.747)	Mondi Plc	Goldman Sachs International	3.182	0,00
(32.400)	MoneyGram International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.899	Moneysupermarket.com Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.337	0,00
(3.500)	MongoDB Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Monogatari Corp	Bank of America Merrill Lynch	608	0,00
100	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.400	Monro Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.100	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.400)	Montauk Renewables Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.000)	Montrose Environmental Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	Moody's Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Moog Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
361.422	Morgan Stanley	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	Morningstar Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.100	Mosaic Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.434)	Mosaic Co	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	MP Materials Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	MPLX LP	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	Mr Cooper Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.100	MRC Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	MSA Safety Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.500)	MSC Industrial Direct Co Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	MSCI Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.029)	MTU Aero Engines AG	Morgan Stanley	20.685	0,00
(1.000)	Mueller Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
16.200	Mueller Water Products Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
16.500	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
600	MYR Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.400	Nabors Industries Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
309.500.334	Nagoya Railroad Co Ltd	Société Générale	0	0,00
300	Nakanishi Inc	Bank of America Merrill Lynch	95	0,00
(400)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7	0,00
(500)	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.000)	Nasdaq Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	National Bank Holdings Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
5.900	National Beverage Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.919)	National Grid Plc	Bank of America Merrill Lynch	463	0,00
7.200	National Health Investors Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	National Instruments Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.400	National Retail Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
15.900	National Storage Affiliates Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
13.100	National Vision Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200.000	NatWest Group Plc	Société Générale	4.436	0,00
1.700	Navient Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	NBT Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.600)	nCino Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(21.800)	NCR Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
44.200	Necessity Retail REIT Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.900)	Nelnet Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.554)	Neobo Fastigheter AB	Morgan Stanley	21.199	0,00
(2.800)	Neogen Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
29.700	NeoGenomics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.437)	Nestle SA	Goldman Sachs International	6.660	0,00
10.500	NetApp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(102.270)	Netflix Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	NetScout Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.200)	NETSTREIT Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(85.130)	Network International Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.414	0,00
1.400	Nevro Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	New Fortress Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.400)	New Jersey Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.500)	New Relic Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
25.436	New York Community Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
19.400	Newmark Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.700)	Newmont Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(23.700)	News Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(13.700)	News Corp Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
2.788.178	Nexi SpA	Société Générale	107.427	0,02
(1.100)	NexPoint Residential Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Nexstar Media Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.868	Next Fifteen Communications Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	6.709	0,00
478	Next Plc	Bank of America Merrill Lynch	785	0,00
(3.250)	Next Plc	Goldman Sachs International	391	0,00
400	Nextage Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	133	0,00
12.995	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.557.694	NextEra Energy Partners LP	Société Générale	4.899	0,00
(1.700)	NextEra Energy Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.200)	NextGen Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(26.000)	NextTier Oilfield Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
39.000	NGM Biopharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.700	NH Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	651	0,00
(2.900)	NHK Spring Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	292	0,00
100	Nifco Inc	Bank of America Merrill Lynch	42	0,00
100	Nihon Kohden Corp	Bank of America Merrill Lynch	65	0,00
8.400	NIKE Inc Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
(84)	Nikola Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	149	0,00
(1.400)	Nippon Kayaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	49	0,00
300	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	75	0,00
(4.700)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.740	0,00
200	Nippon Soda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	485	0,00
244.655.890	Nippon Steel Corp	Société Générale	0	0,00
400	Nippon Steel Trading Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.038	0,00
6.100	Nippon Television Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.455	0,00
38.427.600	Nipro Corp	Société Générale	0	0,00
130.467	NiSource Inc	Goldman Sachs International	7.921	0,00
(100)	Nissan Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	629	0,00
3.200	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.159	0,00
1.400	Nisshinbo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	86	0,00
1.100	Nissui Corp	Bank of America Merrill Lynch	401	0,00
1.200	Nitto Boseki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	206	0,00
1.600	NMI Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
19.382	NN Group NV	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.200)	Noble Corp	Goldman Sachs International	1.505	0,00
(7.000)	Noble Corp Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	NOF Corp	Bank of America Merrill Lynch	538	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.800	NOK Corp	Bank of America Merrill Lynch	110	0,00
11.700	Nomad Foods Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
8.200	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	972	0,00
(1.200)	Nordson Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.900	Nordstrom Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(900)	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Noritsu Koki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.561	0,00
3.900	Northern Oil and Gas Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Northern Trust Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.203)	Northrop Grumman Corp	Morgan Stanley	0	0,00
13.800	Northwest Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	Northwest Natural Holding Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	NorthWestern Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.300	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	NOV Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Novanta Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.000)	Novocure Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.700)	NOW Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.600)	NRG Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	NS Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	68	0,00
400	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.407	0,00
7.800	NSK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	71	0,00
(2.900)	NTN Corp	Bank of America Merrill Lynch	161	0,00
(300)	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	9	0,00
(4.100)	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Nucor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.900)	NuStar Energy LP	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Nutanix Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.300	NuVasive Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	NV5 Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	nVent Electric Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
50.761	NVIDIA Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
100	NVR Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	NXP Semiconductors NV	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.200)	Oak Street Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.565)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.973	0,00
1.417.955	Ocado Group Plc	Société Générale	160.341	0,03
8.700	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Oceaneering International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.800	OceanFirst Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(20.505)	OCI NV	Morgan Stanley	449	0,00
(200)	ODP Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.100)	Office Properties Income Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	OFG Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.300)	OGE Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.600	O-I Glass Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.033.377	Okta Inc	Goldman Sachs International	37.566	0,01
700	OKUMA Corp	Bank of America Merrill Lynch	348	0,00
(60.800)	Olaplex Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Old National Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.500)	Old Republic International Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Olin Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.000	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(274.917)	Omega Healthcare Investors Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.300	Omniceil Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.500)	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.400)	On Holding AG Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	ON Semiconductor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.100	ONE Gas Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	OneMain Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.400)	ONEOK Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Onto Innovation Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(13.300)	Open Lending Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.100)	Option Care Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Oporun Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	55	0,00
(21.900)	Oracle Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.167)	Orange SA	Société Générale	0	0,00
200	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.800)	Organon & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
3.140	Orient Corp	Bank of America Merrill Lynch	584	0,00
100	Oriental Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.460	0,00
3.600	Orion Engineered Carbons SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	ORIX Corp	Bank of America Merrill Lynch	54	0,00
1.734.988	Ormat Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	0	0,00
(4.800)	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.678)	Orsted A/S	Morgan Stanley	5.950	0,00
(300)	Osaka Soda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	604	0,00
500	OSG Corp	Bank of America Merrill Lynch	58	0,00
6.500	Oshkosh Corp	Goldman Sachs International	0	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
500	OSI Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
31.638	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.600)	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.500)	Otter Tail Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.300	Outfront Media Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.000	Outset Medical Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	Overstock.com Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.600)	Ovintiv Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	Owens & Minor Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
15.699	Owens Corning	Goldman Sachs International	0	0,00
3.400	Owl Rock Capital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.000	Oxford Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(25.916)	PACCAR Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Pacific Biosciences of California Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.200	Pacific Premier Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.300	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Packaging Corp of America	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.800)	PacWest Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.000)	PagerDuty Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.700	Pagseguro Digital Ltd Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
40.200	Palantir Technologies Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.600	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Palomar Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Panasonic Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	31	0,00
(3.000)	Papa John's International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.800	Par Pacific Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.900)	PAR Technology Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(22.400)	Paramount Global Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
14.800	Paramount Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.200	Park Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.025	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.700	Parsons Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.100)	Pathward Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.800)	Patrick Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.400)	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.500	Patterson-UTI Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.400	Paychex Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.000	Paycom Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Paycor HCM Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
21.800	Payoneer Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
29.600	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.761	PBF Energy Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.300	PDC Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Pebblebrook Hotel Trust	Goldman Sachs International	264	0,00
2.100	Pediatrix Medical Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Pegasystems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
26.200	Peloton Interactive Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
12.800	Penn Entertainment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.000)	PennyMac Financial Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
41.600	PennyMac Mortgage Investment Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.180)	Penske Automotive Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Pentair Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.700	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	429	0,00
(3.800)	Penumbra Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
183.946	PepsiCo Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.500)	Perdoceo Education Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Perficient Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Performance Food Group Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.900)	Perimeter Solutions SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Perion Network Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	PerkinElmer Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.200	Permian Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.900)	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16	0,00
15.200	Petco Health & Wellness Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.193)	Pets at Home Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	100	0,00
(22.800)	Pfizer Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.300)	PG&E Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	PGT Innovations Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.600)	Phillips 66	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.500)	Phillips Edison & Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.266	Phoenix Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.191	0,00
(3.900)	Photronics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Phreesia Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Physicians Realty Trust	Goldman Sachs International	10	0,00
(600)	Piedmont Lithium Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Piedmont Office Realty Trust Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.600)	Pilgrim's Pride Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Pilot Corp	Bank of America Merrill Lynch	980	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
3.000	Pinnacle Financial Partners Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.300	Pinnacle West Capital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Pinterest Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Piper Sandler Cos	Goldman Sachs International	0	0,00
632.852	Pirelli & C SpA	Goldman Sachs International	299	0,00
3.800	PJT Partners Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.000	Plains All American Pipeline LP	Goldman Sachs International	0	0,00
4.100	Plains GP Holdings LP Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.600	Planet Fitness Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.300)	Planet Labs PBC	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.200)	Playa Hotels & Resorts NV	Goldman Sachs International	0	0,00
18.988	Playtech Plc	Bank of America Merrill Lynch	506	0,00
40.000	Playtika Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Plexus Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.000	Pliant Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.700)	Plug Power Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
16.293	Plug Power Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(200)	PNC Financial Services Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.100	PNM Resources Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Polaris Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Portland General Electric Co	Goldman Sachs International	0	0,00
1.700.000	Poseidon Finance 1 Ltd	Société Générale	57.423	0,01
(5.400)	Poshmark Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.800	Post Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
443.951	Postal Savings Bank of China Ltd	Société Générale	0	0,00
5.500	PotlatchDeltic Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Power Integrations Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.600)	PowerSchool Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.600)	PPG Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
16.700	PPL Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.000)	PRA Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Premier Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Pressance Corp	Bank of America Merrill Lynch	34	0,00
(4.300)	Prestige Consumer Healthcare Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	PriceSmart Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Primerica Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.500	Primoris Services Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.600	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.100	ProAssurance Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.600)	PROCEPT BioRobotics Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(7.000)	Procore Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
83.618	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.200)	PROG Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	Progress Software Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.500	Progressive Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
10.600	Progyny Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.637)	Prologis Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.300	ProPetro Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
300	PROS Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Prosperity Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
56.600	Proterra Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.800	Proto Labs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.200	Provident Financial Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
75.040	Prysmian SpA	Goldman Sachs International	4.020	0,00
900.000	Prysmian SpA	Société Générale	158.499	0,02
1.600	PTC Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.600)	Public Service Enterprise Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	Public Storage	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.800)	PulteGroup Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.043.629	Pure Storage Inc Class A	Goldman Sachs International	821	0,00
(36.219)	PureCycle Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(900)	PVH Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Q2 Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.600	QIAGEN NV	Goldman Sachs International	0	0,00
11.952	QinetiQ Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	376	0,00
6.100	Qorvo Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(900)	Quaker Chemical Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
8.800	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.912)	Qualtrics International Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
5.900	Qualys Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Quanta Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.436	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(55.100)	QuantumScape Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Quest Diagnostics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.000)	Quidel Corp	Goldman Sachs International	26.279	0,00
(39.189)	Quilter Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.404	0,00
13.300	R1 RCM Holdco Inc	Goldman Sachs International	41.868	0,01
3.000	Radian Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.400)	Radius Global Infrastructure Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
13.000	RadNet Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.800	Radware Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Rakuten Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	69	0,00
(900)	Ralph Lauren Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
11.700	Rambus Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
9.700	Range Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Ranger Oil Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Rapid7 Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	Rayonier Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(55.228)	Raytheon Technologies Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	RBC Bearings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(22.200)	Ready Capital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.172.990)	Realty Income Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
600	Reata Pharmaceuticals Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Recruit Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	58	0,00
6.600	Red Rock Resorts Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
15.074	Redde Northgate Plc	Bank of America Merrill Lynch	13.295	0,00
40.700	Redfin Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.409)	Redrow Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.345	0,00
9.200	Redwood Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Regal Rexnord Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
6.800	Regency Centers Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
15.200	Regions Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Reinsurance Group of America Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Reliance Steel & Aluminum Co	Goldman Sachs International	0	0,00
19.800	Relmada Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Relo Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	178	0,00
47.058.418	Relo Holdings Inc	Société Générale	0	0,00
(1.165)	RELX Plc	Bank of America Merrill Lynch	361	0,00
(11.300)	Remitly Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Renasant Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(84.068)	Renault SA	Goldman Sachs International	9.193	0,00
(1.149)	Renishaw Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.797	0,00
1.900	Rent-A-Center Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(220)	Rentokil Initial Plc	Bank of America Merrill Lynch	29	0,00
113.710	Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs International	285	0,00
(22.900)	Repay Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	Repligen Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(400)	Republic Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.700	Resideo Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	ResMed Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	Resolute Forest Products Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.000	Retail Opportunity Investments Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Revance Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.600)	Revolve Group Inc	Goldman Sachs International	2	0,00
284.905	Rexel SA	Goldman Sachs International	11.189	0,00
(2.400)	Rexford Industrial Realty Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(14.500)	Reynolds Consumer Products Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	RH	Goldman Sachs International	0	0,00
1.178	Rhi Magnesita NV	Bank of America Merrill Lynch	1.095	0,00
(800)	RingCentral Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.924	Rio Tinto Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.286	0,00
(41.600)	Riot Blockchain Inc	Goldman Sachs International	9.450	0,00
40.300	Rivian Automotive Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	RLI Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
26.600	RLJ Lodging Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Robert Half International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
39.100	Robinhood Markets Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	ROBLOX Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.800)	Rocket Cos Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.100	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.549)	Rockwell Automation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(700)	Rogers Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	178	0,00
(3.800)	Roku Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
34.200	Rollins Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.224.593)	Rolls-Royce Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	17.045	0,00
(2.680)	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Rorze Corp	Bank of America Merrill Lynch	74	0,00
3.400	Ross Stores Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
25.893	Rotork Plc	Bank of America Merrill Lynch	11.560	0,00
(1.500)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
1.500	Royal Gold Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
24.000	Royalty Pharma Plc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(24.774)	RPC Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	RPM International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.300	RPT Realty	Goldman Sachs International	0	0,00
200	RS Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
2.900	Rush Enterprises Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
7.173	RWE AG	Société Générale	0	0,00
6.240	RWS Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.057	0,00
(3.500)	RXO INC	Goldman Sachs International	0	0,00
3.200	Ryan Specialty Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Ryder System Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.900	Ryerson Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.900)	Ryman Hospitality Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
89.296	S&P Global Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
84.384	Saab AB Class B	Morgan Stanley	4.147	0,00
23.100	Sabra Health Care REIT Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(53.600)	Sabre Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.468)	Safehold Inc	Goldman Sachs International	376	0,00
(1.229)	Safestore Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	50	0,00
(2.000)	Safety Insurance Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.531.467	Safran SA	Société Générale	0	0,00
34.566	Safran SA	Goldman Sachs International	3.342	0,00
(700)	Saia Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.933	Saia Inc	Morgan Stanley	0	0,00
600	Sakata Seed Corp	Bank of America Merrill Lynch	208	0,00
(3.696.363)	Salesforce Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.100	Sally Beauty Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.572)	Samsara Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.000	SAMTY Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	84	0,00
121.503	Sandvik AB	Morgan Stanley	2.032	0,00
900	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	San-In Godo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	27	0,00
(2.600)	Sanmina Corp	Goldman Sachs International	7.153	0,00
600	Sansan Inc	Bank of America Merrill Lynch	175	0,00
(3.100)	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	111	0,00
800	Sanwa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	59	0,00
241.988	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.400.000	Sasol Financing USA LLC	Société Générale	305.290	0,05
1.925.043	Sasol Ltd	Société Générale	0	0,00
2.200	SBA Communications Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
620.196.516	SBI Holdings Inc	Société Générale	0	0,00
(200)	SBS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	129	0,00
(155.311)	Schaeffler AG	Morgan Stanley	8.992	0,00
(4.000)	Schlumberger Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
40.250	Schneider Electric SE	Goldman Sachs International	20.283	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
2.900	Schneider National Inc Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	Schnitzer Steel Industries Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.106	Scholastic Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.210)	Schroders Plc	Bank of America Merrill Lynch	9.077	0,00
3.600	Schrodinger Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Science Applications International Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Scorpio Tankers Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	Scotts Miracle-Gro Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	SCSK Corp	Bank of America Merrill Lynch	85	0,00
(8.200)	Seacoast Banking Corp of Florida	Goldman Sachs International	0	0,00
(17.300)	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Sealed Air Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.937)	Segro Plc	Bank of America Merrill Lynch	5.350	0,00
6.500	SEI Investments Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Seiko Epson Corp	Bank of America Merrill Lynch	841	0,00
14.213.598	Seino Holdings Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(2.000)	Seiren Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	495	0,00
8.700	Select Medical Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	Selective Insurance Group Inc	Goldman Sachs International	2.295	0,00
(3.800)	Sempra Energy	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Semtech Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Senko Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	173	0,00
14.100	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.600)	Sensient Technologies Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.500)	SentinelOne Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.945)	Serica Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.204	0,00
5.400	Service Corp International	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Service Properties Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
200	ServiceNow Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	ServisFirst Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
26.400	Seven Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.379	0,00
(1.106)	Severn Trent Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.706	0,00
6.600	SFL Corp Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.958)	Shaftesbury Plc	Bank of America Merrill Lynch	82	0,00
5.900	Shake Shack Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Sharp Corp	Bank of America Merrill Lynch	476	0,00
40.340	Shell Plc	Goldman Sachs International	2.835	0,00
(4.009)	Shell Plc	Bank of America Merrill Lynch	72	0,00
9.615	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Shibaura Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	169	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(4.500)	Shift4 Payments Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	Shiga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.815	0,00
(400)	Shimadzu Corp	Bank of America Merrill Lynch	707	0,00
100	Shimamura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	354	0,00
6.300	Shimizu Corp	Bank of America Merrill Lynch	569	0,00
1.100	Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd	Bank of America Merrill Lynch	415	0,00
(300)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.486	0,00
(100)	Shionogi & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	60	0,00
300	Ship Healthcare Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	111	0,00
2.400	Shizuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.308	0,00
6.200	Shoals Technologies Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.600	Shockwave Medical Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Shoei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	108	0,00
(47.500)	Shopify Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Shutterstock Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Shyft Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.458.041	Siemens Energy AG	UBS AG	0	0,00
5.400.000	Siemens Energy Finance BV	UBS AG	2.552.078	0,37
5.800	SIGA Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	Signature Bank	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.100)	Signify Health Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.359	Sika AG	Goldman Sachs International	2.774	0,00
(1.800)	Silgan Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Silicon Laboratories Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.600	Silk Road Medical Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.100)	Silvergate Capital Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	Simmons First National Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.200)	Simon Property Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.400	Simply Good Foods Co	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Simpson Manufacturing Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.600)	Simulations Plus Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
13.000	Sinclair Broadcast Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
93.813	Sirius Real Estate Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.266	0,00
(33.300)	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(17.900)	SITE Centers Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
900	SiteOne Landscape Supply Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.100)	SiTime Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(566)	Sitio Royalties Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(2.800)	Sixth Street Specialty Lending Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	SJW Group	Goldman Sachs International	0	0,00
13.567	Skechers USA Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
6.600	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	823	0,00
3.900	Skyline Champion Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	SkyWest Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.400	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	SL Green Realty Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Sleep Number Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.000)	SLM Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.900	SM Energy Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.200)	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.557)	Smart Metering Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.007	0,00
(100)	Smartsheet Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.522	Smith & Nephew Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.280	0,00
100	SMS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	124	0,00
(48.000)	Snap Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Snap-on Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Snow Peak Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.557	0,00
(3.500)	Snowflake Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.778)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	Morgan Stanley	0	0,00
(3.753)	Sodexo SA	Goldman Sachs International	394	0,00
(49.200)	SoFi Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Sohgo Security Services Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	175	0,00
322.057	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
43.100	Solid Power Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Sompo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.674	0,00
(4.100)	Sonic Automotive Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.000)	Sonoco Products Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Sonos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Sony Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.220	0,00
(1.400)	Sotera Health Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.400)	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.500	South State Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.200)	Southern Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Southern Copper Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.000)	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs International	0	0,00
5.100	Southwest Gas Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.100	Southwestern Energy Co	Goldman Sachs International	0	0,00
10.300	Sovos Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
5.400	SpartanNash Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(119)	Spectris Plc	Bank of America Merrill Lynch	205	0,00
(1.500)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(466)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.738	0,00
(600)	Spire Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(27.813)	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
8.300	Spirit Airlines Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Spirit Realty Capital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Splunk Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	S-Pool Inc	Bank of America Merrill Lynch	73	0,00
(5.800)	Spotify Technology SA	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	Sprinklr Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Sprout Social Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
200	SPS Commerce Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Square Enix Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	339	0,00
14.900	Squarespace Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
5.400	SS&C Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.665)	St James's Place Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.875	0,00
15.700	STAAR Surgical Co	Goldman Sachs International	0	0,00
4.900	STAG Industrial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.270	0,00
(30.600)	Star Bulk Carriers Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
68.182	Starbucks Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Starts Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	409	0,00
3.800	Starwood Property Trust Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.200	State Street Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Steel Dynamics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.300	Steelcase Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.300)	Stem Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Stepan Co	Goldman Sachs International	0	0,00
14.300	StepStone Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Stericycle Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.100)	STERIS Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.200	Sterling Infrastructure Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Steven Madden Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	Stewart Information Services Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.900	Stifel Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(600)	Stock Yards Bancorp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
16.900	StoneCo Ltd Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.700)	StoneX Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.800	STORE Capital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
10.600	Stratasys Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.700)	Strategic Education Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.800)	Stride Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.800)	Stryker Corp	Goldman Sachs International	7.902	0,00
(4.900)	Sturm Ruger & Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Sugi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.019	0,00
200	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	111	0,00
4.800	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	269	0,00
(1.400)	Sumitomo Forestry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	166	0,00
1.800	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.474	0,00
3.200	Sumitomo Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	729	0,00
400	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	135	0,00
(3.000)	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	212	0,00
1.700	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	589	0,00
34.200	Summit Hotel Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.095	Summit Materials Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
14.000	Sumo Logic Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.600)	Sun Communities Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.000	Sun Country Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
45.096	Sunnova Energy International Inc	Goldman Sachs International	1.512	0,00
(1.000)	Sunoco LP	Goldman Sachs International	0	0,00
7.900	SunOpta Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.265)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.500	Sunrun Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.700)	Sunstone Hotel Investors Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	32	0,00
(10.500)	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Supernus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	Surgery Partners Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.200	Suruga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22	0,00
500	Suzuken Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	210	0,00
(3.500)	SVB Financial Group	Goldman Sachs International	0	0,00
5.498	Swatch Group AG	Société Générale	0	0,00
(17.200)	Sweetgreen Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
13.317	Swiss Life Holding AG	Société Générale	0	0,00
2.590.145	Swiss Re AG	Société Générale	0	0,00
(6.400)	Synaptics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
10.500	Synchrony Financial	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Syneos Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(100)	Synopsys Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.200	Synovus Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	Sysco Corp	Goldman Sachs International	3.867	0,00
(300)	Systemex Corp	Bank of America Merrill Lynch	957	0,00
(1.600)	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Taiheiyo Cement Corp	Bank of America Merrill Lynch	183	0,00
(300)	Taiyo Yuden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.091	0,00
100	Takara Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	55	0,00
57.603.024	Takashimaya Co Ltd	Société Générale	0	0,00
2.900	Takashimaya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.475	0,00
(5.200)	Take-Two Interactive Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.600	Takuma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.317	0,00
1.000	Talos Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.300	Tanger Factory Outlet Centers Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	Tapestry Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	Targa Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.200	Target Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(21.100)	Target Hospitality Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Taylor Morrison Home Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.090	TBC Bank Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	220	0,00
300	TD SYNEX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
6.500	TE Connectivity Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
35.600	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	TechTarget Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.000)	Teekay Tankers Ltd Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.100)	TEGNA Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Teijin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	31	0,00
20.300	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(900)	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	Teleflex Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
18.600	Telephone & Data Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.900)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.100	Tenable Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Tenet Healthcare Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.200	Teradata Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.100	Teradyne Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	Terex Corp	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
3.600	Terreno Realty Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.554	Tesla Inc	Morgan Stanley	502	0,00
(5.400)	Tesla Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Tetra Tech Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Texas Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.300	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(73.309)	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Textainer Group Holdings Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
9.000	Textron Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.290	Thales SA	Goldman Sachs International	722	0,00
1.400	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.900)	Thor Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(28.400)	Thoughtworks Holding Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(17.286)	thyssenkrupp AG	Morgan Stanley	426	0,00
(3.500)	Tidewater Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
500	Timken Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(15.960)	Timken Co	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	TimkenSteel Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.600)	Titan International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.600)	TJX Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	TKP Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.295	0,00
400	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(29.800)	Toast Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.300	Toho Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	715	0,00
(400)	Toho Titanium Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	415	0,00
2.500	Tokai Rika Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	111	0,00
200	Token Corp	Bank of America Merrill Lynch	175	0,00
(1.000)	Tokuyama Corp	Bank of America Merrill Lynch	166	0,00
600	Tokyo Century Corp	Bank of America Merrill Lynch	66	0,00
1.200	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	0	0,00
(100)	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	332	0,00
100	Tokyotokeiba Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	68	0,00
10.000	Toll Brothers Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.500)	Tootsie Roll Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.300	TopBuild Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Topcon Corp	Bank of America Merrill Lynch	13	0,00
400	Toridoll Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	331	0,00
(1.200)	Toro Co	Goldman Sachs International	120	0,00
1.000	Toshiba Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.510	0,00
400	Toshiba TEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	947	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(500)	TOTO Ltd	Bank of America Merrill Lynch	479	0,00
(8.600)	Tower Semiconductor Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Toyo Tire Corp	Bank of America Merrill Lynch	262	0,00
1.000	Toyobo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	124	0,00
(300)	Toyota Industries Corp	Bank of America Merrill Lynch	10	0,00
(2.800)	Toyota Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.178	0,00
(200)	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	310	0,00
36.282	TP ICAP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.400	0,00
4.600	TPG Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Tractor Supply Co	Goldman Sachs International	0	0,00
14.300	Trade Desk Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Tradeweb Markets Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.111)	Trane Technologies Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
61.175.200	Transcosmos Inc	Société Générale	0	0,00
800	TransMedics Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.200	TransUnion	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.500)	Travel + Leisure Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.400)	Travelers Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(36.468)	Travis Perkins Plc	Goldman Sachs International	2.221	0,00
(700)	Treace Medical Concepts Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.700	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
10.000	Trex Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
17.600	TRI Pointe Homes Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.800	Trimble Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	TriNet Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
17.900	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.900	Trinseo Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.900	TripAdvisor Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(12.647)	Tritax Big Box REIT Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.243	0,00
(1.200)	Triton International Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.200)	Triumph Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.300)	Tronox Holdings Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.000)	Truist Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.700)	Trupanion Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.300)	Trusco Nakayama Corp	Bank of America Merrill Lynch	394	0,00
4.400	Trustmark Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
100	TS Tech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11	0,00
(3.600)	TTEC Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.000	TTM Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.716.931	TUI AG	UBS AG	440.643	0,07

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
38.294	TUI AG	Bank of America Merrill Lynch	10.274	0,00
27.025	TuSimple Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
4.300	TV Asahi Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	727	0,00
4.800	Twilio Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Tyler Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.200	Tyson Foods Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	UACJ Corp	Bank of America Merrill Lynch	37	0,00
27.000	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.100	Ubiquiti Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.500	Udemy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.900	UDR Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.700)	UFP Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(800)	UFP Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.600	UGI Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
300	U-Haul Holding Co	Goldman Sachs International	12.096	0,00
(50.800)	UiPath Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.675)	UK Commercial Property REIT Ltd	Bank of America Merrill Lynch	97	0,00
800	Ulta Beauty Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.600)	Ultra Clean Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Ulvac Inc	Bank of America Merrill Lynch	315	0,00
(1.200)	UMB Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
18.100	Umpqua Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
23.700	Under Armour Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
31.000	Under Armour Inc Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	UniFirst Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
23.297	Unilever Plc	Morgan Stanley	112	0,00
(1.100)	Union Pacific Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.235)	UNITE Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.403	0,00
4.800	United Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.600)	United Bankshares Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	United Community Banks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.400	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.000	United Parcel Service Inc Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.200)	United Rentals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.800	United States Cellular Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(55.204)	United States Steel Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.688)	United Utilities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	827	0,00
(800)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
65.200	Uniti Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(36.600)	Unity Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
41.511	Univar Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.600)	Univar Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.800	Universal Display Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Universal Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	618	0,00
(700)	Universal Health Services Inc Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
66.690	Unum Group	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.600)	Upstart Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
34.800	Upwork Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
17.100	Urban Edge Properties	Goldman Sachs International	0	0,00
5.700	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.400	US Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	US Foods Holding Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
3.100	US Physical Therapy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
21.214	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Usen-Next Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	184	0,00
(6.400)	UserTesting Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.100)	Ushio Inc	Bank of America Merrill Lynch	582	0,00
(300)	USS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	132	0,00
(11.200)	Utz Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
300	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs International	3.992	0,00
(300)	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs International	6.050	0,00
(5.600)	Valaris Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(61.928)	Valeo SA	Goldman Sachs International	535	0,00
(8.200)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.700	Valley National Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Valmont Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	Valor Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	725	0,00
(100)	Valvoline Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.900)	Varex Imaging Corp	Goldman Sachs International	169	0,00
(10.600)	Varonis Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.400	Veeco Instruments Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.800	Veeva Systems Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.931.066)	Ventas Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(11.100)	Ventyx Biosciences Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.800)	Verint Systems Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.100	Veris Residential Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
116.157	VeriSign Inc	Goldman Sachs International	7.235	0,00
1.900	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.400	Veritex Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(97.016)	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
(2.000)	Verra Mobility Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
20.600	Vertiv Holdings Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(48.294)	Veru Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
13.116	Vesuvius Plc	Bank of America Merrill Lynch	6.615	0,00
(900)	VF Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Viasat Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
66.747	Viatis Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(59.100)	Viatis Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.700	Viavi Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
28.900	VICI Properties Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.200	Vicor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(18.000)	Victoria's Secret & Co	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Victory Capital Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(700)	Viper Energy Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
282.678	Virgin Galactic Holdings Inc	Société Générale	0	0,00
(25.900)	Virgin Galactic Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.700)	Virtu Financial Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Virtus Investment Partners Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.000)	Visa Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.920.500	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	56.900	0,01
(12.400)	Vista Outdoor Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.271	Visteon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.300)	Visteon Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
200	Vistra Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
5.440	Vistry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	212	0,00
45.400	Vizio Holding Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
3.800	VMware Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.277)	Volkswagen AG	Morgan Stanley	3.580	0,00
273.900	Volvo AB Class B	Morgan Stanley	287	0,00
(7.600)	Vontier Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.500)	Vornado Realty Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Voya Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.900)	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs International	0	0,00
24.100	W&T Offshore Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.500	Wabash National Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.400)	Walker & Dunlop Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.067)	Walmart Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(23.000)	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.100)	Warby Parker Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
175.500	Warner Bros Discovery Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
6.600	Warner Music Group Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
2.300	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.900)	Washington Federal Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.600)	Waste Management Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.025)	Watches of Switzerland Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	8.817	0,00
100	Waters Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.927)	Watsco Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	Watsco Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
600	Watts Water Technologies Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
371.903	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.600)	WD-40 Co	Goldman Sachs International	0	0,00
3.000	Weatherford International Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Weathernews Inc	Bank of America Merrill Lynch	143	0,00
5.600	Webster Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.200	WEC Energy Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.420)	Weir Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	705	0,00
(4.500)	Weis Markets Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	194	0,00
(21.500)	Welltower Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
14.200	Wendy's Co	Goldman Sachs International	0	0,00
1.600	Werner Enterprises Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.700	WesBanco Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.753	WESCO International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(600)	WESCO International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.700)	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.600)	Westamerica Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
400	Western Alliance Bancorp	Goldman Sachs International	0	0,00
11.200	Western Digital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.600	Western Midstream Partners LP	Goldman Sachs International	0	0,00
6.800	Western Union Co	Goldman Sachs International	0	0,00
81.513	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs International	884	0,00
(700)	Westlake Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.100	Westrock Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.200)	WEX Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(17.100)	Weyerhaeuser Co	Goldman Sachs International	0	0,00
3.503	Whirlpool Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.812)	Whitbread Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.558	0,00
51.000	WideOpenWest Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
54.146	Williams Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Williams-Sonoma Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
600	Wills Towers Watson Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
11.600	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
2.600	Wingstop Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.170	Winnebago Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.500	Wintrust Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.253)	Wise Plc	Bank of America Merrill Lynch	269	0,00
2.600	Wix.com Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(68.557)	Wizz Air Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	16.421	0,00
(7.400)	Wolfspeed Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.757)	Wolters Kluwer NV	Morgan Stanley	80	0,00
100	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.800	Woodward Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.956)	Woodward Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.500	Workday Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
1.900	Workiva Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(67)	Workspace Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1	0,00
(1.500)	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
800	World Wrestling Entertainment Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
7.600	Worthington Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(6.800)	WP Carey Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(508)	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	162	0,00
900	W-Scope Corp	Bank of America Merrill Lynch	564	0,00
(1.100)	WSFS Financial Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(500)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(535.578)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
3.700	Xcel Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
28.700	Xenia Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
26.100	Xerox Holdings Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(7.200)	Xometry Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(28.900)	XP Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.000)	XPEL Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.040)	Xperi Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(8.900)	XPO Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.500	Xylem Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(200)	Yakult Honsha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	403	0,00
8.800	Yamada Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	954	0,00
9.700	Yamaguchi Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.238	0,00
300	Yamaha Corp	Bank of America Merrill Lynch	40	0,00
2.700	YA-MAN Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.158	0,00
100	Yamato Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22	0,00

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,96 % (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
800	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	829	0,00
595.602.940	Yaoko Co Ltd	Société Générale	0	0,00
100	Yaoko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12	0,00
(700)	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	439	0,00
2.478.691	Yeahka Ltd	Société Générale	64.316	0,01
(3.315)	Yellow Cake Plc	Bank of America Merrill Lynch	35	0,00
22.400	Yelp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.700)	YETI Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Yokohama Rubber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	101	0,00
1.400	Yonex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	198	0,00
(800)	Yoshinoya Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9	0,00
(10.700)	Yum China Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
800	Yum! Brands Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(4.824)	Zalando SE	Morgan Stanley	0	0,00
(1.500)	Zebra Technologies Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
8.200	Zeta Global Holdings Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.100)	Ziff Davis Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.000	Zillow Group Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
6.500	Zillow Group Inc Class C	Goldman Sachs International	0	0,00
(16.500)	ZIM Integrated Shipping Services Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.800)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
8.500	Zions Bancorp NA	Goldman Sachs International	0	0,00
3.600	ZipRecruiter Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
9.600	Zoetis Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
7.600	Zoom Video Communications Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
100	ZoomInfo Technologies Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Zscaler Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
686.745	ZTO Express Cayman Inc	Société Générale	0	0,00
(5.200)	Zuora Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
146.518	Zur Rose Group AG	Société Générale	0	0,00
(15.500)	Zurn Elkay Water Solutions Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten <sup>o</sup></b>			<b>13.934.583</b>	<b>1,96</b>

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Gekaufte Swaptions 0,01 %**

Nominalwert	Fälligkeit	Beschreibung	Gegenpartei	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Call Swaptions</b>					
120.000.000 EUR	18.01.2023	EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 120,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S38, strike 1.05%	JPMorgan Chase Bank	68.848	0,01
<b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: (334.506) US\$)</b>				<b>68.848</b>	<b>0,01</b>

**Zinsswap-Kontrakte 0,14 %**

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens	
EUR	422.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	3,37 %	1D EURIBOR	374.130	0,05
EUR	422.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	3,45 %	1D EURIBOR	286.716	0,04
EUR	500.000.000	15.03.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	2,26 %	1D EURIBOR	249.224	0,04
EUR	894.000.000	22.03.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	2,36 %	1D EURIBOR	60.778	0,01
EUR	432.000.000	22.03.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	2,35 %	1D EURIBOR	34.648	0,00
GBP	833.000.000	02.02.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	3,43 %	1D SONIA	18.908	0,00
EUR	400.000.000	18.04.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	2,47 %	1D EURIBOR	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>1.024.404</b>	<b>0,14</b>	

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

**Total Return Swap-Kontrakte 0,10 %**

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
2.497.932 USD	17.03.2023	0,00 <sup>1</sup>	Société Générale Basket SGBVRRU <sup>2</sup>	650.693	0,09
495.611 USD	19.01.2023	0,15 <sup>3</sup>	Société Générale Basket SGEPBSH <sup>2</sup>	23.520	0,01
1.701.287 USD	01.08.2023	4,30 <sup>1</sup>	S&P 500 TR Index <sup>4</sup>	4.031	0,00
1.009.446 USD	19.04.2023	0,00 <sup>3</sup>	Goldman Sachs Basket GSVICQ1E <sup>4</sup>	0	0,00
379.729 USD	19.04.2023	0,00 <sup>3</sup>	Goldman Sachs Basket GSVILG10 <sup>4</sup>	0	0,00
1.542.543 USD	19.04.2023	0,00 <sup>3</sup>	Goldman Sachs Basket GSVIRVU2 <sup>4</sup>	0	0,00
(3.334.469) EUR	06.10.2023	1,91 <sup>5</sup>	STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services Index <sup>4</sup>	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>678.244</b>	<b>0,10</b>

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Société Générale.<sup>3</sup> Fester Zinssatz.<sup>4</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-ESTR.

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Variance-Swap-Kontrakte 0,04 %

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation	Volatilität-Ausübungssatz	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
600.000 USD	20.11.2024	Goldman Sachs International	GS 128 Pairwise Theta Flat CoVol	Various	86.140	0,01
200.000 USD	20.01.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 128 Pairwise Theta Flat Geo	Various	226.660	0,03
60.000 USD	20.12.2024	Goldman Sachs International	Euro STOXX 50 Index vs S&P 500 Index	Various	6.327	0,00
100.000 USD	20.12.2024	BNP Paribas	BNP US Geo Basket	Various	0	0,00
50.000 USD	20.12.2024	BNP Paribas	BNP 15 Names EU Basket	Various	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Variance-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>319.127</b>	<b>0,04</b>

### Volatility-Swap-Kontrakte 0,19 %

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation <sup>1</sup>	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens	
6.250.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 12 Names US Basket	304.748	0,04	
5.000.000 USD	20.01.2023	UBS	UBS 32 Names US Basket	200.869	0,03	
25.000.000 EUR	15.12.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 14 Names EU Basket	139.316	0,02	
30.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 12 Names EU Down Geo Basket	137.510	0,02	
11.350.000 EUR	15.12.2023	BNP	SOLWGOAL Index Basket	129.232	0,02	
25.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 10 Names EU Down Geo Basket	66.659	0,01	
12.500.000 USD	20.01.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 15 Names US Basket	52.008	0,01	
7.500.000 EUR	15.12.2023	BNP	BNP 20 Names Slider European Basket	44.213	0,01	
10.000.000 EUR	20.06.2024	BNP	BNP 20 Names Slider European Basket	40.918	0,01	
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	35.651	0,01	
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	35.651	0,01	
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	35.651	0,00	
514.500.000 JPY	15.12.2023	BNP	SOLWGOAL vs Nikkei 225 Index Basket	32.642	0,00	
250.003 USD	20.12.2024	BNP	BNP Down Pairwise US	28.943	0,00	
20.000.000 USD	19.01.2024	Bank of America Merrill Lynch	BAML 17 Names US Basket	23.592	0,00	
62.500 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	17.826	0,00	
62.500 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	17.826	0,00	
6.500.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 12 Names US Geo Basket	0	0,00	
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>1.343.255</b>	<b>0,19</b>

<sup>1</sup>Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

### Correlation-Swap-Kontrakte 0,00 %

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation	Korrelation zum Ausübungszeitpunkt in Prozent	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
1.000.000 USD	14.06.2023	BNP	USD FX correlation swap EUR/BRL vs USD/BRL	90,30 %	0	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>0</b>	<b>0,00</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>598.691.431</b>	<b>84,10</b>

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (0,88 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.565.136 AUD	1.000.000 €	19.01.2023	Bank of America	4	(6.324)	(0,00)
8.100.000 AUD	5.564.799 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	(68.228)	(0,01)
11.000.000 AUD	1.007.365.210 ¥	19.01.2023	Bank of America	7	(186.122)	(0,03)
200.000 AUD	183.888 CAD	19.01.2023	Bank of America	1	(8)	(0,00)
1.052.982 BRL	200.000 US\$	02.02.2023	Bank of America	1	(1.750)	(0,00)
8.360.783 BRL	1.600.000 US\$	04.01.2023	Bank of America	17	(16.445)	(0,00)
3.600.000 CAD	357.721.974 ¥	19.01.2023	Bank of America	8	(59.655)	(0,01)
3.247.661 CAD	2.250.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	(6.853)	(0,00)
10.800.000 CAD	7.982.333 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	(10.965)	(0,00)
1.643.111 CAD	1.800.000 AUD	19.01.2023	Bank of America	6	(8.698)	(0,00)
5.875.000 CHF	6.367.264 US\$	19.01.2023	Bank of America	5	(6.396)	(0,00)
737.703 CHF	750.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	(2.594)	(0,00)
963.128.713 COP	200.000 US\$	12.01.2023	Bank of America	1	(1.689)	(0,00)
957.793.357 COP	200.000 US\$	23.01.2023	Bank of America	2	(3.197)	(0,00)
956.418.713 COP	200.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	1	(3.331)	(0,00)
480.509.357 COP	100.000 US\$	20.01.2023	Bank of America	1	(1.211)	(0,00)
40.600.000 €	5.867.148.825 ¥	19.01.2023	Bank of America	6	(1.181.672)	(0,18)
250.000 €	364.737 CAD	19.01.2023	Bank of America	1	(2.107)	(0,00)
400.000 €	1.889.477 PLN	19.01.2023	Bank of America	3	(2.882)	(0,00)
700.000 €	288.963.982 HUF	19.01.2023	Bank of America	5	(18.520)	(0,00)
125.000 €	1.318.582 NOK	19.01.2023	Bank of America	1	(389)	(0,00)
1.125.000 €	1.792.996 AUD	19.01.2023	Bank of America	1	(14.749)	(0,00)
500.000 €	493.920 CHF	19.01.2023	Bank of America	2	(564)	(0,00)
34.561.615 £	39.800.000 €	19.01.2023	Bank of America	11	(930.748)	(0,14)
8.125.000 £	9.916.381 US\$	19.01.2023	Bank of America	7	(138.651)	(0,02)
8.000.000 £	1.318.823.621 ¥	19.01.2023	Bank of America	8	(388.722)	(0,05)
1.625.000 £	1.843.084 CHF	19.01.2023	Bank of America	9	(39.963)	(0,01)
3.250.000 £	5.868.618 AUD	19.01.2023	Bank of America	8	(71.290)	(0,01)
8.233.087 INR	100.000 US\$	13.01.2023	Bank of America	1	(558)	(0,00)
8.261.587 INR	100.000 US\$	17.01.2023	Bank of America	1	(244)	(0,00)
24.648.162 INR	300.000 US\$	09.01.2023	Bank of America	2	(2.193)	(0,00)
1.288.052.790 ¥	9.200.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	(47.024)	(0,01)
346.877.412 ¥	4.200.000 NZD	19.01.2023	Bank of America	1	(22.472)	(0,00)
1.250.000.000 ¥	9.533.814 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	(40.481)	(0,01)
3.921.385 NOK	375.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	(2.324)	(0,00)
5.859.182 NOK	600.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	(4.833)	(0,00)
2.500.000 NZD	1.602.871 US\$	19.01.2023	Bank of America	4	(21.390)	(0,00)
849.475 NZD	800.000 AUD	19.01.2023	Bank of America	2	(5.499)	(0,00)
8.200.000 NZD	709.155.612 ¥	19.01.2023	Bank of America	6	(198.540)	(0,03)



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0.88 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
467.869 PLN	100.000 €	19.01.2023	Bank of America	1	(304)	(0,00)
6.895.015 SEK	625.000 €	19.01.2023	Bank of America	3	(5.404)	(0,00)
1.043.204 SEK	1.000.000 NOK	19.01.2023	Bank of America	2	(1.366)	(0,00)
4.081.265 SEK	400.000 US\$	19.01.2023	Bank of America	2	(7.944)	(0,00)
73.231.623 TRY	3.800.000 US\$	15.02.2023	Bank of America	7	(15.423)	(0,00)
9.152.599 TWD	300.000 US\$	30.01.2023	Bank of America	3	(1.544)	(0,00)
6.058.709 TWD	200.000 US\$	09.01.2023	Bank of America	2	(2.766)	(0,00)
9.152.655 TWD	300.000 US\$	17.01.2023	Bank of America	2	(1.842)	(0,00)
26.496.657 US\$	3.580.070.491 ¥	19.01.2023	Bank of America	10	(692.782)	(0,10)
307.801 US\$	399.256.426 KRW	03.01.2023	Bank of America	2	(7.942)	(0,00)
100.000 US\$	130.427.011 KRW	13.01.2023	Bank of America	1	(3.658)	(0,00)
300.000 US\$	406.186 SGD	19.01.2023	Bank of America	2	(2.955)	(0,00)
251.959 US\$	400.000 NZD	19.01.2023	Bank of America	2	(1.078)	(0,00)
400.000 US\$	523.585.881 KRW	09.01.2023	Bank of America	3	(15.520)	(0,00)
300.000 US\$	2.969.816 NOK	19.01.2023	Bank of America	1	(1.670)	(0,00)
5.089.229 US\$	101.500.000 MXN	19.01.2023	Bank of America	8	(104.022)	(0,01)
1.000.000 US\$	394.949.900 HUF	19.01.2023	Bank of America	3	(47.509)	(0,01)
100.000 US\$	127.213.411 KRW	30.01.2023	Bank of America	1	(1.146)	(0,00)
100.000 US\$	130.135.311 KRW	25.01.2023	Bank of America	1	(3.457)	(0,00)
400.000 US\$	523.926.634 KRW	20.01.2023	Bank of America	2	(16.468)	(0,00)
300.000 US\$	390.747.364 KRW	19.01.2023	Bank of America	1	(10.596)	(0,00)
100.000 US\$	131.108.011 KRW	17.01.2023	Bank of America	1	(4.210)	(0,00)
100.000 US\$	3.066.705 TWD	31.01.2023	Bank of America	1	(10)	(0,00)
20.617.419 US\$	28.100.000 CAD	19.01.2023	Bank of America	6	(122.899)	(0,02)
900.000 US\$	4.775.232 BRL	04.01.2023	Bank of America	6	(4.442)	(0,00)
100.000 US\$	128.085.311 KRW	27.01.2023	Bank of America	1	(1.832)	(0,00)
13.167.854 US\$	19.600.000 AUD	19.01.2023	Bank of America	6	(132.491)	(0,02)
400.000 US\$	6.987.506 ZAR	19.01.2023	Bank of America	2	(10.108)	(0,00)
100.000 US\$	8.296.160 INR	17.01.2023	Bank of America	1	(174)	(0,00)
13.800.000 US\$	95.860.891 CNH	19.01.2023	Bank of America	7	(72.634)	(0,01)
200.000 US\$	973.701.287 COP	12.01.2023	Bank of America	1	(488)	(0,00)
100.000 US\$	87.044.044 CLP	27.01.2023	Bank of America	1	(1.933)	(0,00)
300.000 US\$	266.600.288 CLP	23.01.2023	Bank of America	3	(12.329)	(0,00)
55.554 US\$	296.338 BRL	03.01.2023	Bank of America	1	(573)	(0,00)
100.000 US\$	89.337.144 CLP	20.01.2023	Bank of America	1	(4.693)	(0,00)
100.000 US\$	8.295.750 INR	13.01.2023	Bank of America	1	(199)	(0,00)
900.000 US\$	784.895.337 CLP	09.01.2023	Bank of America	2	(20.837)	(0,00)
1.400.000 US\$	1.232.053.017 CLP	17.01.2023	Bank of America	4	(44.270)	(0,01)
9.568.008 US\$	8.875.000 CHF	19.01.2023	Bank of America	8	(40.964)	(0,01)
100.000 US\$	2.276.728 CZK	19.01.2023	Bank of America	1	(504)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0.88 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
16.682.237 US\$	15.750.000 €	19.01.2023	Bank of America	6	(145.190)	(0,02)
512.340 US\$	456.217.360 CLP	03.01.2023	Bank of America	2	(23.158)	(0,00)
3.537.404 US\$	3.500.000 €	31.01.2023	Goldman Sachs International	4	(205.319)	(0,03)
15.150.768 US\$	14.250.000 €	09.01.2023	Goldman Sachs International	5	(62.960)	(0,01)
796.343 US\$	750.000 CHF	09.01.2023	Goldman Sachs International	1	(14.726)	(0,00)
50.958 US\$	50.000 CHF	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	(3.255)	(0,00)
7.690.999 US\$	1.036.000.000 ¥	10.01.2023	Goldman Sachs International	4	(167.163)	(0,02)
292.639 US\$	40.589.000 ¥	20.12.2023	Goldman Sachs International	1	(30.921)	(0,00)
1.000.000 US\$	7.001.200 CNH	31.01.2023	Goldman Sachs International	1	(14.159)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
51.495 €	55.014 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
3.839.763 US\$	3.785.897 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(204.822)	(0,03)
11.822.362 US\$	11.539.112 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	50	(505.211)	(0,07)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(6.317.151)</b>	<b>(0,88)</b>

## Futures-Kontrakte(0,69 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
39	3 Month SOFR Future December 2023	(6.899)	(0,00)
38	3 Month SOFR Future March 2024	(8.153)	(0,00)
(587)	3 Month SOFR Future March 2023	(150.829)	(0,02)
587	3 Month SOFR Future March 2023	(44.089)	(0,01)
(83)	3 Month SONIA Future June 2023	(11.995)	(0,00)
82	3 Month SONIA Future September 2023	(12.006)	(0,00)
79	3 Month SONIA Future December 2023	(19.568)	(0,00)
(124)	3 Month SONIA Future March 2024	(48.233)	(0,01)
1.243	30 Day Federal Funds Future February 2023	(45.183)	(0,01)
(606)	30 Day Federal Funds Future January 2023	(15.578)	(0,00)
200	3-Month Euro Euribor Future January 2023	(3.424)	(0,00)
120	3-Month Euro Euribor Future February 2023	(7.069)	(0,00)
621	3-Month Euro Euribor Future March 2023	(204.281)	(0,03)
27	90-Day Bank Bill Future June 2023	(9.889)	(0,00)
141	90-Day Bank Bill Future March 2023	(10.748)	(0,00)
21	90-Day Bank Bill Future December 2023	(12.307)	(0,00)
(109)	Australian Dollar Currency Future March 2023	(30.904)	(0,00)
251	Australian Government Bond 10-Year Future March 2023	(998.582)	(0,14)
159	Bankers Acceptance Future March 2023	(59.652)	(0,01)
171	Bankers Acceptance Future June 2023	(90.225)	(0,01)
268	Bankers Acceptance Future December 2023	(183.752)	(0,03)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,69 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1	Brazil Real Currency Future January 2023	(155)	(0,00)
8	CBOE VIX Index Future January 2023	(6.165)	(0,00)
(24)	DJIA Mini E-CBOT Future March 2023	(8.119)	(0,00)
(1)	E-mini Euro Future March 2023	(481)	(0,00)
1	E-mini Health Care Future March 2023	(1.040)	(0,00)
8	E-mini Russell 2000 Index Future March 2023	(1.097)	(0,00)
120	Euro-Bund Future February 2023	(112.017)	(0,02)
(120)	Euro-Bund Future February 2023	(654.005)	(0,09)
(3)	Euro Currency Future March 2023	(205)	(0,00)
28	Euro STOXX 50 Future March 2023	(7.834)	(0,00)
300	Euro STOXX 50 Index Dividend Future December 2023	(114.295)	(0,02)
(40)	Euro STOXX 50 Index Dividend Future December 2024	(2.561)	(0,00)
42	Euro STOXX 50 Index Dividend Future December 2025	(2.380)	(0,00)
(1)	FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2023	(134)	(0,00)
1	FTSE/MIB Index Future March 2023	(64)	(0,00)
(1)	Hang Seng China Enterprises Index Future February 2023	(936)	(0,00)
5	Hang Seng Index Future February 2023	(4.190)	(0,00)
1	IBEX 35 Index Future January 2023	(1.203)	(0,00)
(2)	Indian Rupee Currency Future July 2023	(58)	(0,00)
48	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2023	(331.274)	(0,05)
16	KOSPI 200 Index Future March 2023	(23.448)	(0,00)
(7)	Mexican Peso Currency Future March 2023	(115)	(0,00)
(1)	Mini-Hang Seng China Enterprises Index Future February 2023	(54)	(0,00)
9	MSCI EAFE Index Future March 2023	(7.440)	(0,00)
12	MSCI Emerging Markets Index Future March 2023	(7.520)	(0,00)
2	MSCI Singapore Index Future February 2023	(104)	(0,00)
(29)	Nasdaq 100 E-mini Future March 2023	(33.003)	(0,00)
12	Nikkei 225 (SGX) Future March 2023	(19.535)	(0,00)
1	S&P E-mini S&P MidCap 400 Future March 2023	(320)	(0,00)
51	S&P/TSX 60 Index Future March 2023	(189.256)	(0,03)
1	STOXX Europe 600 Index Future March 2023	(251)	(0,00)
298	United Kingdom Long Gilt Future March 2023	(920.014)	(0,13)
23	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2023	(41.156)	(0,01)
344	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2023	(287.812)	(0,04)
66	VSTOXX Future February 2023	(5.042)	(0,00)
295	VSTOXX Future March 2023	(39.486)	(0,01)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Futures-Kontrakte (0,69 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
200	VSTOXX Future January 2023	(46.062)	(0,01)
35	Yen Denominated Nikkei Future March 2023	(80.401)	(0,01)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>		<b>(4.922.598)</b>	<b>(0,69)</b>

## Verkaufte Optionskontrakte (5,98 %)

Anzahl Kontrakte Nominalwert	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufoptionen</b>				
(2.400)	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(387.500)	(0,05)
(1.600)	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(110.000)	(0,02)
(111)	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$65 ±	(34.965)	(0,00)
(93)	20.01.2023	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$78 ±	(2.464)	(0,00)
(100.000)	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$101 ∞	(642.050)	(0,09)
(100.000)	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$38 ∞	(2.382.053)	(0,34)
(432)	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$18 ±	(22.680)	(0,00)
(341)	20.01.2023	AT&T Inc, Strike Price \$21 ±	(682)	(0,00)
(14)	20.01.2023	Broadcom Inc, Strike Price \$480 ±	(114.310)	(0,02)
(50.000)	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$92 ∞	(305.497)	(0,04)
(2)	17.03.2023	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,660 ±	(2.820)	(0,00)
(166)	20.01.2023	Cisco Systems Inc, Strike Price \$42 ±	(93.375)	(0,01)
(74)	20.01.2023	CVS Caremark Corp, Strike Price \$95 ±	(8.584)	(0,00)
(155.000)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	(639.169)	(0,09)
(155.000)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR16 ∞	(662.580)	(0,09)
(3.499)	16.06.2023	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR22 ±	(22.406)	(0,00)
(28)	20.01.2023	Dollar General Corp, Strike Price \$250 ±	(11.900)	(0,00)
(10.000)	17.03.2023	Dow Jones vs Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR115 ∞	(24.106)	(0,00)
(55)	17.03.2023	Eastman Chemical Co, Strike Price \$75 ±	(50.600)	(0,01)
(30.000)	19.09.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	(583.649)	(0,08)
(30.000)	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	(589.158)	(0,08)
(30.000)	19.11.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	(596.645)	(0,08)
(50.000)	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$95 ∞	(38.345)	(0,01)
(8)	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,700 ±	(12.556)	(0,00)
(4)	20.01.2023	Hang Seng Index Future, Strike Price HKD19,500 ±	(20.474)	(0,00)
(50.000)	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$231 ∞	(4.858.207)	(0,69)
(5)	17.03.2023	Lithia Motors Inc, Strike Price \$195 ±	(12.075)	(0,00)
(588)	17.03.2023	Lumen Technologies Inc, Strike Price \$7 ±	(5.586)	(0,00)
(200.000)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$32 ∞	(61.299)	(0,01)
(65)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$48 ±	(1.755)	(0,00)
(30.661)	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$137 ∞	(636.524)	(0,09)
(10.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$111 ∞	(4.267)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (5,98 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(100.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$117 <sup>∞</sup>	(32.833)	(0,00)
(363)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$145 <sup>±</sup>	(12.523)	(0,00)
(13)	17.03.2023	McDonalds Corp, Strike Price \$260 <sup>±</sup>	(16.542)	(0,00)
(74)	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$55 <sup>±</sup>	(131.350)	(0,02)
(50)	17.03.2023	MetLife Inc, Strike Price \$65 <sup>±</sup>	(43.250)	(0,01)
(16)	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$245 <sup>±</sup>	(20.240)	(0,00)
(28)	20.01.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$255 <sup>±</sup>	(4.886)	(0,00)
(11)	17.03.2023	Microsoft Corp, Strike Price \$290 <sup>±</sup>	(1.468)	(0,00)
(60.000)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$140 <sup>∞</sup>	(1.253.441)	(0,19)
(75.000)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$151 <sup>∞</sup>	(1.214.475)	(0,18)
(123)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$165 <sup>±</sup>	(23.063)	(0,00)
(50.000)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$172 <sup>∞</sup>	(78.631)	(0,01)
(300.000)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$28 <sup>∞</sup>	(205.045)	(0,03)
(306)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$37 <sup>±</sup>	(0)	(0,00)
(67)	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$63 <sup>±</sup>	(20.937)	(0,00)
(45)	17.03.2023	Realty Income Corp, Strike Price \$75 <sup>±</sup>	(450)	(0,00)
(1)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,910 <sup>±</sup>	(2.613)	(0,00)
(4)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,000 <sup>±</sup>	(4.300)	(0,00)
(3)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,050 <sup>±</sup>	(1.763)	(0,00)
(14)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,090 <sup>±</sup>	(4.725)	(0,00)
(23)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,800 <sup>±</sup>	(231.150)	(0,03)
(20)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,800 <sup>±</sup>	(573.900)	(0,08)
(6)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,870 <sup>±</sup>	(88.410)	(0,01)
(2)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,950 <sup>±</sup>	(40.390)	(0,01)
(4)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,960 <sup>±</sup>	(40.940)	(0,01)
(1)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,990 <sup>±</sup>	(12.750)	(0,00)
(2)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,025 <sup>±</sup>	(32.940)	(0,00)
(60)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 <sup>±</sup>	(1.500)	(0,00)
(12)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 <sup>±</sup>	(12.900)	(0,00)
(3)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,350 <sup>±</sup>	(15.555)	(0,00)
(2)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,400 <sup>±</sup>	(3.610)	(0,00)
(2)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,425 <sup>±</sup>	(7.450)	(0,00)
(1)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,550 <sup>±</sup>	(755)	(0,00)
(6)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,900 <sup>±</sup>	(300)	(0,00)
(100.000)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$73 <sup>∞</sup>	(6.609.861)	(0,94)
(88)	16.06.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR14 <sup>±</sup>	(41.324)	(0,01)
(1.384)	17.03.2023	Siemens Energy AG, Strike Price EUR15 <sup>±</sup>	(454.200)	(0,06)
(100.000)	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$33 <sup>∞</sup>	(215.660)	(0,03)
(5)	04.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,050 <sup>±</sup>	(1.285)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (5,98 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(6)	30.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,200 ±	(2.225)	(0,00)
(27)	17.03.2023	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$125 ±	(5.062)	(0,00)
(159)	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$21 ±	(81.090)	(0,01)
(134)	17.03.2023	United States Steel Corp, Strike Price \$25 ±	(35.376)	(0,01)
(20.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$165 ∞	(8.475)	(0,00)
(40.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$198 ∞	(9.468)	(0,00)
(73)	17.03.2023	Wells Fargo & Co, Strike Price \$45 ±	(6.752)	(0,00)
(12)	17.03.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$58 ±	(31.770)	(0,00)
(65)	17.03.2023	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$65 ±	(129.675)	(0,02)
<b>Verkaufsoptionen</b>				
(400)	13.01.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(35.000)	(0,00)
(1.600)	10.02.2023	3 Month SOFR Future, Strike Price \$95 ±	(260.000)	(0,04)
(40.090)	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$115 ∞	(1.106.247)	(0,16)
(11.737)	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$43 ∞	(121.858)	(0,02)
(14.074)	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105 ∞	(564.749)	(0,08)
(161.000)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11 ∞	(63.661)	(0,01)
(161.000)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11 ∞	(67.519)	(0,01)
(161.000)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR12 ∞	(83.194)	(0,01)
(25.200)	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73 ∞	(473.906)	(0,07)
(7.317)	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price \$108 ∞	(552.938)	(0,08)
(334)	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,300 ±	(139.078)	(0,02)
(10)	20.01.2023	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,700 ±	(12.108)	(0,00)
(5)	20.01.2023	Hang Seng Index Future, Strike Price HKD19,500 ±	(12.460)	(0,00)
(10.483)	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price \$294 ∞	(468.052)	(0,07)
(42.205)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price \$42 ∞	(1.205.203)	(0,18)
(8.507)	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$153 ∞	(228.322)	(0,03)
(3.193)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$126 ∞	(248.940)	(0,03)
(31.126)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price \$133 ∞	(2.640.800)	(0,38)
(17.159)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$178 ∞	(749.716)	(0,11)
(25.002)	19.01.2024	Middleby Corp, Strike Price \$193 ∞	(1.380.628)	(0,19)
(2)	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,250 ±	(18.114)	(0,00)
(4)	13.01.2023	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY27,750 ±	(50.627)	(0,01)
(12.335)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price \$220 ∞	(1.743.041)	(0,25)
(72.984)	20.01.2023	Pure Storage Inc, Strike Price \$31 ∞	(328.369)	(0,05)
(80)	31.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,400 ±	(21.000)	(0,00)
(66)	31.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,750 ±	(165.825)	(0,02)
(160)	17.02.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,750 ±	(626.000)	(0,09)
(1)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,840 ±	(3.338)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (5,98 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte Nominalwert	Fällig- keit	Art	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(30)	20.01.2023	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$3,890 ±	(135.375)	(0,02)
(2)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,750 ±	(1.760)	(0,00)
(4)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,775 ±	(8.240)	(0,00)
(4)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,825 ±	(9.140)	(0,00)
(11)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$2,950 ±	(7.370)	(0,00)
(3)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,350 ±	(22.500)	(0,00)
(22)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,360 ±	(59.070)	(0,01)
(1)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,360 ±	(4.635)	(0,00)
(3)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,390 ±	(15.255)	(0,00)
(2)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,425 ±	(17.820)	(0,00)
(12)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,600 ±	(80.580)	(0,01)
(22)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,800 ±	(123.310)	(0,02)
(8)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,850 ±	(118.120)	(0,02)
(4)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,855 ±	(59.900)	(0,01)
(4)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,860 ±	(60.780)	(0,01)
(6)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,870 ±	(93.780)	(0,01)
(3)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,950 ±	(76.920)	(0,01)
(4)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,960 ±	(80.180)	(0,01)
(1)	21.04.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,990 ±	(24.105)	(0,00)
(2)	16.06.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,025 ±	(58.470)	(0,01)
(4)	17.03.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$4,225 ±	(154.080)	(0,02)
(12.140)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$83 ∞	(92.735)	(0,01)
(16.873)	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$38 ∞	(329.149)	(0,05)
(3)	04.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,000 ±	(195)	(0,00)
(2)	04.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,050 ±	(176)	(0,00)
(7)	30.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,100 ±	(2.813)	(0,00)
(1)	30.01.2023	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD14,700 ±	(1.009)	(0,00)
USD (270.000)	20.03.2023	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY140 ∞	(19.277)	(0,00)
(4.618)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$210 ∞	(771.803)	(0,11)
(9.429)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price \$253 ∞	(1.955.351)	(0,28)
<b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: 41.535.747 US\$)</b>			<b>(42.460.180)</b>	<b>(5,98)</b>

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind BNP Paribas, Goldman Sachs International und JPMorgan Chase Bank.

### Differenzkontrakte (0,46 %)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht- realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
(3.100)	77 Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.957)	(0,00)
(100)	ABC-Mart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.161)	(0,00)
(6.300)	ABM Industries Inc	Goldman Sachs International	(401)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
800.000	Accor SA	Société Générale	(297.425)	(0,05)
(2.600)	Acom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(150)	(0,00)
(200)	Adastria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(544)	(0,00)
(2.600)	Adeia Inc	Goldman Sachs International	(14.924)	(0,00)
(1.200)	ADEKA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(182)	(0,00)
(4.558)	ADT Inc	Goldman Sachs International	(21)	(0,00)
(1.000)	Advantest Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.847)	(0,00)
(7.200)	Aeon Mall Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.420)	(0,00)
(100)	Ai Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14)	(0,00)
(1.083.027)	Air France-KLM	Goldman Sachs International	(1.877)	(0,00)
700	Aisin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(194)	(0,00)
13.000	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs International	(20.140)	(0,00)
(500)	Alfresa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(33)	(0,00)
(87.578)	Alstom SA	Goldman Sachs International	(3.402)	(0,00)
(1.700)	Amano Corp	Bank of America Merrill Lynch	(252)	(0,00)
(1.700)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs International	(6.885)	(0,00)
48.922	Andritz AG	Morgan Stanley	(3.926)	(0,00)
(1.787)	Anglo American Plc	Bank of America Merrill Lynch	(163)	(0,00)
5.100	Anritsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(864)	(0,00)
(963)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	(622)	(0,00)
(11)	AP Moller - Maersk A/S Class B	Morgan Stanley	(2.755)	(0,00)
7.682	Apple Inc	Goldman Sachs International	(14.227)	(0,00)
(9.975)	Apple Inc	Morgan Stanley	(5.235)	(0,00)
(17.611)	ArcelorMittal SA	Morgan Stanley	(1.332)	(0,00)
800	Ariake Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(425)	(0,00)
300	Asahi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)	(0,00)
1.000	Asahi Intecc Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(707)	(0,00)
(1.200)	Asics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(291)	(0,00)
(1.400)	ASKUL Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.214)	(0,00)
6.448	ASOS Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.931)	(0,00)
(202.154)	Assa Abloy AB Class B	Morgan Stanley	(14.473)	(0,00)
(1.703)	AstraZeneca Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.753)	(0,00)
(121.480)	Atlas Copco AB Class A	Morgan Stanley	(6.252)	(0,00)
3.500	Atlassian Corp Class A	Goldman Sachs International	(3.731)	(0,00)
(6.697)	AVEVA Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.171)	(0,00)
22.755	Aviva Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.085)	(0,00)
3.405	Axon Enterprise Inc	Goldman Sachs International	(11.586)	(0,00)
2.100	Azbil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.450)	(0,00)
(1.600)	AZ-COM MARUWA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(313)	(0,00)
(6.818)	B&M European Value Retail SA	Bank of America Merrill Lynch	(517)	(0,00)



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
200	Bandai Namco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(383)	(0,00)
136	Bank of Georgia Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(47)	(0,00)
(94.700)	Bausch Health Cos Inc	Goldman Sachs International	(92)	(0,00)
(20.267)	Beazley Plc	Bank of America Merrill Lynch	(14.844)	(0,00)
(33.322)	Beijer Ref AB	Morgan Stanley	(786)	(0,00)
(300)	Benesse Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52)	(0,00)
400	BeNext-Yumeshin Group Co	Bank of America Merrill Lynch	(107)	(0,00)
900	Bengo4.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.261)	(0,00)
(4.700)	Bic Camera Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.339)	(0,00)
919	Biffa Plc	Bank of America Merrill Lynch	(57)	(0,00)
948	Big Yellow Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(195)	(0,00)
(600)	BIPROGY Inc	Bank of America Merrill Lynch	(151)	(0,00)
(200)	BML Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(0,00)
136	Bodycote Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(0,00)
(130.198)	BP Plc	Goldman Sachs International	(3.710)	(0,00)
15.698	Bridgepoint Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.763)	(0,00)
800	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	(688)	(0,00)
12.136	British Land Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.080)	(0,00)
2.300	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(815)	(0,00)
300	Brown-Forman Corp Class B	Goldman Sachs International	(2.511)	(0,00)
12.629	BT Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(380)	(0,00)
1.843	Bunzl Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.434)	(0,00)
1.911	Burberry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.558)	(0,00)
4.961	Burford Capital Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(700)	(0,00)
13.393	C&C Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(34)	(0,00)
(900)	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(290)	(0,00)
100	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs International	(177)	(0,00)
400	Canon Inc	Bank of America Merrill Lynch	(155)	(0,00)
100	Capcom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18)	(0,00)
(39.148)	Capital & Counties Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.223)	(0,00)
(11.086)	Capricorn Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.877)	(0,00)
2.000.000	Carnival Corp	Société Générale	(218.500)	(0,04)
(1.400)	Casio Computer Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(432)	(0,00)
1.116.488	Cellnex Telecom SA	Société Générale	(0)	(0,00)
(26.603)	Centamin Plc	Bank of America Merrill Lynch	(810)	(0,00)
4.158	Centene Corp	Goldman Sachs International	(21.862)	(0,00)
2.200	Central Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.596)	(0,00)
474	Ceres Power Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(205)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(3.600)	Chiba Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(772)	(0,00)
800	Chipotle Mexican Grill Inc Class A	Goldman Sachs International	(41.650)	(0,02)
(2.600)	Chubu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.815)	(0,00)
(76.117)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Goldman Sachs International	(3.162)	(0,00)
(600)	Citizen Watch Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(33)	(0,00)
(8.100)	Clearway Energy Inc Class C	Goldman Sachs International	(2.981)	(0,00)
46.782	Coats Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(441)	(0,00)
(2.100)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(713)	(0,00)
5.000	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Goldman Sachs International	(3.167)	(0,00)
(300)	Colowide Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46)	(0,00)
(7.100)	Concordia Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(242)	(0,00)
(1.300)	Contra Abiomed Inc	Goldman Sachs International	(1.950)	(0,00)
(14.971)	ConvaTec Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(680)	(0,00)
300	Cosmos Pharmaceutical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(817)	(0,00)
5.753	CoStar Group Inc	Goldman Sachs International	(1.864)	(0,00)
950.000	Credit Agricole SA	Société Générale	(4.123)	(0,00)
2.200.000	Credit Suisse Group AG	Société Générale	(349.573)	(0,06)
(2.877)	CRH Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.725)	(0,00)
17.615	Croda International Plc	Goldman Sachs International	(4.565)	(0,00)
107.559	Currys Plc	Bank of America Merrill Lynch	(10.722)	(0,00)
25.539	CVS Health Corp	Goldman Sachs International	(1.120)	(0,00)
(100)	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)	(0,00)
(500)	Cybozu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(125)	(0,00)
(300)	Daicel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(26)	(0,00)
400	Daifuku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.972)	(0,00)
(2.600)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.304)	(0,00)
300	Daiichi Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(171)	(0,00)
(200)	Daiichikosho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(65)	(0,00)
136.594	Daimler Truck Holding AG	Morgan Stanley	(33.018)	(0,01)
5.800	Daio Paper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(234)	(0,00)
100	Daito Trust Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(73)	(0,00)
(1.600)	Daiwa House Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(781)	(0,00)
(500)	Daiwa Securities Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(0,00)
1.025	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs International	(783)	(0,00)
(8.283)	Dassault Aviation SA	Goldman Sachs International	(2.048)	(0,00)
908	DCC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.074)	(0,00)
4.500	Demae-Can Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.313)	(0,00)
1.800	Denka Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(335)	(0,00)
602.096	Deutsche Lufthansa AG	Morgan Stanley	(41.407)	(0,02)
1.400	Dexerials Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.946)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(4.297)	Diageo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.048)	(0,00)
600	DIC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(338)	(0,00)
(1.700)	Digital Garage Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.379)	(0,00)
29.500	DigitalBridge Group Inc	Goldman Sachs International	(5.605)	(0,00)
(100)	Disco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.861)	(0,00)
4.700.000	DISH Network Corp	Société Générale	(2.143)	(0,00)
(55.449)	Dometic Group AB	Morgan Stanley	(1.210)	(0,00)
(4.100)	Douglas Emmett Inc	Goldman Sachs International	(44)	(0,00)
700	Dowa Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(93)	(0,00)
21.629	Dr ING hc F Porsche AG	Morgan Stanley	(11.032)	(0,00)
500	DTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(179)	(0,00)
(3.540)	Dunelm Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(974)	(0,00)
(200)	Duskin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34)	(0,00)
(1.800)	EDION Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.606)	(0,00)
(100)	Eisai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(663)	(0,00)
(161.967)	Electrolux AB Class B	Morgan Stanley	(3.178)	(0,00)
(8.800)	Element Solutions Inc	Goldman Sachs International	(68)	(0,00)
(2.500)	ENEOS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(95)	(0,00)
(300)	en-japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(134)	(0,00)
4.190	Entain Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.136)	(0,00)
(40.368)	Epiroc AB Class A	Morgan Stanley	(617)	(0,00)
500	eRex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(301)	(0,00)
40.584	Essity AB Class B	Morgan Stanley	(158)	(0,00)
(3.200)	euglena Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(0,00)
(800)	Exedy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(576)	(0,00)
(1.300)	EXEO Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.248)	(0,00)
(1.500.000)	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	(12.493)	(0,00)
(400)	Ezaki Glico Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(750)	(0,00)
733	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs International	(16.055)	(0,00)
(96.047)	Farfetch Ltd Class A	Goldman Sachs International	(1.931)	(0,00)
300	Federal Realty Investment Trust	Goldman Sachs International	(202)	(0,00)
(1.100)	Financial Partners Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(146)	(0,00)
(61.608)	Firstgroup Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.603)	(0,00)
935	Fluence Energy Inc	Morgan Stanley	(817)	(0,00)
89.842	Ford Motor Co	Goldman Sachs International	(127.881)	(0,03)
3.594	Frasers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(735)	(0,00)
100	Freee KK	Bank of America Merrill Lynch	(122)	(0,00)
(8.983)	Fresnillo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.906)	(0,00)
600	Fuji Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.747)	(0,00)
(400)	Fuji Kyuko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.065)	(0,00)
(9.100)	Fuji Media Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.522)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
100	Fuji Soft Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41)	(0,00)
(1.300)	Fujitec Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(381)	(0,00)
(2.100)	Future Corp	Bank of America Merrill Lynch	(614)	(0,00)
(764)	Gamma Communications Plc	Bank of America Merrill Lynch	(56)	(0,00)
100	Garmin Ltd	Goldman Sachs International	(569)	(0,00)
3.646	GB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(761)	(0,00)
(2.983)	Geberit AG	Goldman Sachs International	(3.254)	(0,00)
60	Genus Plc	Bank of America Merrill Lynch	(77)	(0,00)
(18.192)	Getinge AB Class B	Morgan Stanley	(1.129)	(0,00)
(100)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.108)	(0,00)
(400)	Goldwin Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.360)	(0,00)
(23.545)	Grainger Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.925)	(0,00)
6.000	Gree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(647)	(0,00)
(2.286)	Greggs Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.530)	(0,00)
15.624	GSK Plc	Bank of America Merrill Lynch	(43.164)	(0,02)
(900)	GungHo Online Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(706)	(0,00)
(13.500)	Gunma Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.105)	(0,00)
(4.200)	Hakuhodo DY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.002)	(0,00)
(800)	Hakuto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.771)	(0,00)
(14.815)	Haleon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(440)	(0,00)
3.761	Halma Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.527)	(0,00)
(500)	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America Merrill Lynch	(192)	(0,00)
1.800	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(117)	(0,00)
34.700	Healthcare Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	(9.640)	(0,00)
(800)	Heiwa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(493)	(0,00)
5.173	Henkel AG & Co KGaA – Preferred Shares	Morgan Stanley	(1.485)	(0,00)
2.210	Hill & Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	(70)	(0,00)
10.100	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.745)	(0,00)
100	Hirose Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(380)	(0,00)
(400)	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(409)	(0,00)
(13.274)	Hiscox Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20.451)	(0,00)
700	Hitachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(819)	(0,00)
(2.100)	Hokkaido Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(332)	(0,00)
(9.400)	Hokuriku Electric Power Co	Bank of America Merrill Lynch	(2.394)	(0,00)
14.533	Holcim Ltd	Goldman Sachs International	(268)	(0,00)
160.702	Home Reit Plc	Bank of America Merrill Lynch	(39.850)	(0,02)
(600)	Hoshizaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.469)	(0,00)
96.327	Howden Joinery Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6.079)	(0,00)
(149.052)	Husqvarna AB Class B	Morgan Stanley	(2.409)	(0,00)
64.177	Iberdrola SA	Morgan Stanley	(1.697)	(0,00)
(200)	Ibiden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(535)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(300)	Ichibanya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(648)	(0,00)
5.600	Ichigo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(232)	(0,00)
3.119	IG Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(532)	(0,00)
(1.700)	IHI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(304)	(0,00)
(2.400)	Iino Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.018)	(0,00)
(4.526)	Impax Asset Management Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7.689)	(0,00)
(2.717)	Indivior Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16.020)	(0,00)
14.425	Infineon Technologies AG	Morgan Stanley	(589)	(0,00)
8.900	Infomart Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.969)	(0,00)
(2.800)	Informatica Inc Class A	Goldman Sachs International	(147)	(0,00)
900	Information Services International-Dentsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(605)	(0,00)
1.800.000	ING Groep NV	Société Générale	(35.280)	(0,01)
(11.418)	IntegraFin Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(12.216)	(0,00)
23.575	International Consolidated Airlines Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(2.181)	(0,00)
(1.300)	Internet Initiative Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.351)	(0,00)
1.300	Intuit Inc	Goldman Sachs International	(24.432)	(0,01)
6.137	IP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(391)	(0,00)
(8.600)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.908)	(0,00)
800	Ito En Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(522)	(0,00)
(100)	ITOCHU Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(0,00)
500	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36)	(0,00)
(1.500)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(315)	(0,00)
(200)	Iwatani Corp	Bank of America Merrill Lynch	(54)	(0,00)
(25.617)	IWG Plc	Bank of America Merrill Lynch	(771)	(0,00)
(261)	J D Wetherspoon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(0,00)
(2.100)	Jaccs Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.912)	(0,00)
(900)	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(42)	(0,00)
(400)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.177)	(0,00)
46.500	Japan Display Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.831)	(0,00)
(300)	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(114)	(0,00)
(1.100)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(236)	(0,00)
(1.300)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(195)	(0,00)
1.000	Japan Steel Works Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.385)	(0,00)
2.700	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(611)	(0,00)
(23.336)	JD Sports Fashion Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.235)	(0,00)
2.400	Jeol Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14.201)	(0,00)
654	JET2 Plc	Bank of America Merrill Lynch	(430)	(0,00)
(1.200)	JFE Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)	(0,00)
2.200	JGC Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(549)	(0,00)
(300)	JINS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(332)	(0,00)
800	JMDC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.183)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(2.100)	Joyful Honda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.559)	(0,00)
1.000	JTEKT Corp	Bank of America Merrill Lynch	(111)	(0,00)
400.000	Just Eat Takeaway.com NV	Société Générale	(685)	(0,00)
400	Justsystems Corp	Bank of America Merrill Lynch	(369)	(0,00)
(40.729)	K+S AG	Morgan Stanley	(1.803)	(0,00)
(1.000)	Kagome Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(687)	(0,00)
1.772	Kainos Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(172)	(0,00)
(800)	Kajima Corp	Bank of America Merrill Lynch	(312)	(0,00)
200	Kakaku.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64)	(0,00)
(1.300)	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(754)	(0,00)
(1.300)	Kanamoto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(45)	(0,00)
(100)	Kanematsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(0,00)
(3.900)	Kansai Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.374)	(0,00)
2.700	Kansai Paint Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.256)	(0,00)
100	Katitas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37)	(0,00)
(1.300)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.975)	(0,00)
(300)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(0,00)
(1.100)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(54)	(0,00)
1.394	Kering SA	Goldman Sachs International	(99)	(0,00)
300	Kewpie Corp	Bank of America Merrill Lynch	(83)	(0,00)
29.500	KeyCorp	Goldman Sachs International	(20.657)	(0,00)
4.420	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs International	(1.330)	(0,00)
(500)	KH Neochem Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(63)	(0,00)
500	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.390)	(0,00)
547.735	Kingfisher Plc	Bank of America Merrill Lynch	(192)	(0,00)
(21.402)	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs International	(12)	(0,00)
2.000	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.371)	(0,00)
3.100	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(962)	(0,00)
(300)	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(608)	(0,00)
(200)	Ki-Star Real Estate Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(575)	(0,00)
1.000	Koa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(827)	(0,00)
(1.000)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(514)	(0,00)
(1.000)	Kobe Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(0,00)
(400)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(310)	(0,00)
(900)	Kohnan Shoji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.538)	(0,00)
(300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(69)	(0,00)
(2.300)	Kokuyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.583)	(0,00)
(1.700)	KOMEDA Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.461)	(0,00)
(1.300)	Komeri Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(279)	(0,00)
(47.612)	Kone OYJ Class B	Morgan Stanley	(3.277)	(0,00)
(75.072)	Konecranes OYJ	Morgan Stanley	(3.218)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(25.800)	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	(1.457)	(0,00)
9.969	Kroger Co	Goldman Sachs International	(1.970)	(0,00)
900	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	(707)	(0,00)
(1.800)	Kumagai Gumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.171)	(0,00)
1.000	Kura Sushi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(779)	(0,00)
1.000	Kureha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.179)	(0,00)
100	Kurita Water Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(175)	(0,00)
(400)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.181)	(0,00)
(100)	KYB Corp	Bank of America Merrill Lynch	(64)	(0,00)
(300)	Kyudenko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(561)	(0,00)
(15.400)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.046)	(0,00)
(100)	Kyushu Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(0,00)
(3.784)	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.131)	(0,00)
(200)	Lasertec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.045)	(0,00)
23.569	Learning Technologies Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.008)	(0,00)
48.309	Legal & General Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(223)	(0,00)
(65.939)	Legrand SA	Goldman Sachs International	(5.960)	(0,00)
(900)	Life Corp	Bank of America Merrill Lynch	(924)	(0,00)
1.800	Link And Motivation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(220)	(0,00)
(500)	Lintec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(59)	(0,00)
600	Lixil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29)	(0,00)
1.500.000	Lloyds Banking Group Plc	Société Générale	(8.939)	(0,00)
(235.722)	Lloyds Banking Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.494)	(0,00)
(1.232)	L'Oreal SA	Goldman Sachs International	(1.223)	(0,00)
1.062	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Goldman Sachs International	(112)	(0,00)
41.841	LXI REIT Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.581)	(0,00)
21.729	LyondellBasell Industries NV Class A	Goldman Sachs International	(92.815)	(0,02)
(200)	M&A Capital Partners Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(405)	(0,00)
(56.824)	M&G Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.158)	(0,00)
400	M3 Inc	Bank of America Merrill Lynch	(411)	(0,00)
600	Mabuchi Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(209)	(0,00)
(400)	Mani Inc	Bank of America Merrill Lynch	(497)	(0,00)
100	Marathon Digital Holdings Inc	Goldman Sachs International	(205)	(0,00)
3.000.000	Marriott Vacations Worldwide Corp	Société Générale	(3.764)	(0,00)
11.122	Marshalls Plc	Bank of America Merrill Lynch	(746)	(0,00)
(3.100)	Marubeni Corp	Bank of America Merrill Lynch	(630)	(0,00)
(500)	Maruichi Steel Tube Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(52)	(0,00)
200	Maruwa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(168)	(0,00)
10.935	Match Group Inc	Goldman Sachs International	(23.370)	(0,01)
(2.400)	Materion Corp	Goldman Sachs International	(245)	(0,00)
(4.400)	Matsui Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.118)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(600)	MatsukiyoCocokara & Co	Bank of America Merrill Lynch	(2.447)	(0,00)
8.366	Mediclinic International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(137)	(0,00)
(700)	Medley Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.554)	(0,00)
(600)	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(404)	(0,00)
1.400	Meidensha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(155)	(0,00)
(600)	MEIJI Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.276)	(0,00)
2.728.763	Melrose Industries Plc	Bank of America Merrill Lynch	(37.472)	(0,02)
(500)	Mercari Inc	Bank of America Merrill Lynch	(977)	(0,00)
23.097	Mercedes-Benz Group AG	Morgan Stanley	(7.615)	(0,00)
(750.000)	Microchip Technology Inc	Société Générale	(2.973)	(0,00)
11.833	Middleby Corp	Goldman Sachs International	(2.155)	(0,00)
(1.800)	MIRAIT ONE corp	Bank of America Merrill Lynch	(554)	(0,00)
1.500	Mitsubishi Estate Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(135)	(0,00)
800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65)	(0,00)
400	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(355)	(0,00)
400	Mitsubishi Logistics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(221)	(0,00)
(15.400)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.959)	(0,00)
(1.600)	Mitsuboshi Belting Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.090)	(0,00)
(1.100)	Mitsui & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.687)	(0,00)
(600)	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29)	(0,00)
(100)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(17)	(0,00)
900	Mitsui High-Tec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.194)	(0,00)
(200)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40)	(0,00)
500	Mitsui OSK Lines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(134)	(0,00)
(300)	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(488)	(0,00)
(700)	Mixi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(503)	(0,00)
(500)	Mizuho Leasing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(266)	(0,00)
3.200	Monex Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35)	(0,00)
(100)	Money Forward Inc	Bank of America Merrill Lynch	(135)	(0,00)
1.900	MonotaRO Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(606)	(0,00)
(1.400)	Morinaga & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(969)	(0,00)
(1.300)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.312)	(0,00)
(1.400)	MOS Food Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.570)	(0,00)
(1.900)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.381)	(0,00)
(100)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(0,00)
(900)	Nabtesco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(634)	(0,00)
(1.700)	Nagoya Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(269)	(0,00)
21.314	National Express Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(79)	(0,00)
(101.405)	NatWest Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(15.965)	(0,00)
(200)	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(0,00)
(1.400)	NEC Networks & System Integration Corp	Bank of America Merrill Lynch	(456)	(0,00)



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(200)	NET One Systems Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(482)	(0,00)
(1.900)	Nexon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.798)	(0,00)
(200)	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(0,00)
1.000	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(201)	(0,00)
(1.100)	Nichias Corp	Bank of America Merrill Lynch	(320)	(0,00)
2.000	Nichicon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(609)	(0,00)
(1.300)	Nichirei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.849)	(0,00)
600	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.023)	(0,00)
1.200	Nihon M&A Center Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(673)	(0,00)
(200)	Nikkon Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(59)	(0,00)
4.200	Nikon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.138)	(0,00)
1.167	Ninety One Plc	Bank of America Merrill Lynch	(68)	(0,00)
400	Nintendo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(0,00)
(100)	Nippon Parking Development Co Ltd Class C	Bank of America Merrill Lynch	(64)	(0,00)
3.000	Nippon Sanso Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(775)	(0,00)
500	Nippon Shinyaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(313)	(0,00)
(200)	Nippon Shokubai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(56)	(0,00)
(300)	Nippon Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63)	(0,00)
(2.000)	Nippon Yusen KK	Bank of America Merrill Lynch	(1.939)	(0,00)
(1.600)	Nipro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(166)	(0,00)
(1.100)	Nishimatsu Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.112)	(0,00)
(500)	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(152)	(0,00)
(5.500)	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.882)	(0,00)
1.300	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(827)	(0,00)
223.569	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.911)	(0,00)
(1.200)	Nissha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(290)	(0,00)
(400)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.096)	(0,00)
(300)	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11.255)	(0,00)
(1.700)	Nojima Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.758)	(0,00)
1.400	Nomura Real Estate Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.351)	(0,00)
(200)	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(0,00)
(21.015)	Novozymes A/S Class B	Morgan Stanley	(1.619)	(0,00)
200	NSD Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(77)	(0,00)
1.100	Obayashi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(0,00)
(500)	OBIC Business Consultants Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(0,00)
100	Obic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(312)	(0,00)
(2.400)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(169)	(0,00)
(7.000)	Oji Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(772)	(0,00)
(1.000)	Okumura Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.568)	(0,00)
900	Olympus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.523)	(0,00)
14.540	Omega Healthcare Investors Inc	Goldman Sachs International	(22.227)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(200)	Omron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(175)	(0,00)
700	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(538)	(0,00)
400	Open House Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37)	(0,00)
800	Optex Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(237)	(0,00)
(200)	Oracle Corp Japan	Bank of America Merrill Lynch	(1.052)	(0,00)
(54.200)	Orchid Island Capital Inc	Goldman Sachs International	(1.398)	(0,00)
(1.800)	Organo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.945)	(0,00)
2.400.000	Ormat Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.819)	(0,00)
(100)	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(0,00)
100	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(185)	(0,00)
(2.016)	OSB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(0,00)
100	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16)	(0,00)
500	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(320)	(0,00)
1.200	Outsourcing Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28)	(0,00)
(1.914)	Oxford Instruments Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.359)	(0,00)
7.721	Pagegroup Plc	Bank of America Merrill Lynch	(672)	(0,00)
(200)	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(127)	(0,00)
(600)	PALTAC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.018)	(0,00)
140	Paragon Banking Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(29)	(0,00)
(1.500)	Park24 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.925)	(0,00)
11.585	Pearson Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.162)	(0,00)
(1.400)	Pebblebrook Hotel Trust	Goldman Sachs International	(110)	(0,00)
7.464	Pennon Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.793)	(0,00)
(900)	PeptiDream Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.386)	(0,00)
2.864	Persimmon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.029)	(0,00)
16.632	Petershill Partners Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.571)	(0,00)
(1.300)	Pigeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(357)	(0,00)
4.100	Piolax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.835)	(0,00)
3.782	Plus500 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(947)	(0,00)
(1.100)	Pola Orbis Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.684)	(0,00)
206	Pool Corp	Morgan Stanley	(3.988)	(0,00)
(1.866)	Pool Corp	Goldman Sachs International	(185)	(0,00)
53.988	Primary Health Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.018)	(0,00)
(2.600)	Prudential Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.101)	(0,00)
(17.200)	R1 RCM Inc	Goldman Sachs International	(1.239)	(0,00)
(1.100)	Raito Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.092)	(0,00)
(400)	Raksul Inc	Bank of America Merrill Lynch	(667)	(0,00)
200	Rakus Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(165)	(0,00)
(1.491)	Randstad NV	Morgan Stanley	(193)	(0,00)
(2.746)	Rathbones Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(12.328)	(0,00)
10.071	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs International	(2.471)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
58.864	Redrow Plc	Goldman Sachs International	(370)	(0,00)
1.400	Renasas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(594)	(0,00)
(1.300)	Rengo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(463)	(0,00)
600	RENOVA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(712)	(0,00)
(6.300)	Resona Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.154)	(0,00)
(1.000)	Resorttrust Inc	Bank of America Merrill Lynch	(788)	(0,00)
100	Revolve Group Inc	Goldman Sachs International	(123)	(0,00)
16.714	Rheinmetall AG	Morgan Stanley	(1.349)	(0,00)
(200)	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15)	(0,00)
3.060	Rightmove Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.964)	(0,00)
(63.847)	Rightmove Plc	Goldman Sachs International	(246)	(0,00)
7.500	Riot Blockchain Inc	Goldman Sachs International	(13.646)	(0,00)
22.400	Rithm Capital Corp	Goldman Sachs International	(9.856)	(0,00)
200	Rohm Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.226)	(0,00)
23.244	RS GROUP Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.379)	(0,00)
75.091	RWE AG	Morgan Stanley	(23.380)	(0,01)
331.388	Ryanair Holdings Plc	Goldman Sachs International	(18.067)	(0,00)
(600)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(450)	(0,00)
(2.208)	S4 Capital Plc	Bank of America Merrill Lynch	(243)	(0,00)
500	Safehold Inc	Goldman Sachs International	(6.032)	(0,00)
1.939.000	Safran SA	Société Générale	(27.501)	(0,01)
22.039	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.391)	(0,00)
(900)	Saizeriya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(449)	(0,00)
11.590	Salesforce Inc	Goldman Sachs International	(370.012)	(0,06)
(125.546)	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	Morgan Stanley	(278)	(0,00)
(1.500)	Sangetsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(204)	(0,00)
(2.200)	San-In Godo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(0,00)
(1.000)	Sanken Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10.604)	(0,00)
(700)	Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.679)	(0,00)
(800)	Sankyu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(761)	(0,00)
200	Sapporo Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(31)	(0,00)
3.599	Savills Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.692)	(0,00)
(11.554)	Schindler Holding AG	Goldman Sachs International	(129)	(0,00)
(300)	SCREEN Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(184)	(0,00)
(1.900)	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(284)	(0,00)
(5.200)	Seibu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.287)	(0,00)
(1.100)	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(0,00)
(100)	Sekisui Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(0,00)
(100)	Sekisui House Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(0,00)
5.900	Septeni Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(501)	(0,00)
51.020	Serco Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.071)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(1.400)	Seria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.396)	(0,00)
900	SG Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(168)	(0,00)
(100)	SHIFT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.021)	(0,00)
(2.800)	Shikoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.112)	(0,00)
500	Shinko Electric Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(269)	(0,00)
2.200	Shinsei Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46)	(0,00)
(900)	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.095)	(0,00)
500	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(106)	(0,00)
(100)	Shochiku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(392)	(0,00)
600	Showa Denko KK	Bank of America Merrill Lynch	(553)	(0,00)
6.478	Siemens AG	Morgan Stanley	(5.954)	(0,00)
7.688	Siemens Healthineers AG	Morgan Stanley	(1.077)	(0,00)
(57.714)	Signify NV	Morgan Stanley	(4.133)	(0,00)
(19.922)	Skanska AB Class B	Morgan Stanley	(800)	(0,00)
(181.383)	SKF AB Class B	Morgan Stanley	(3.951)	(0,00)
1.900	Skylark Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(544)	(0,00)
172.867	Smiths Group Plc	Goldman Sachs International	(22.875)	(0,01)
(6.769)	Smiths Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.905)	(0,00)
696	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(736)	(0,00)
(4.000)	Softbank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.253)	(0,00)
8.781	Softcat Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.221)	(0,00)
(1.100)	Sojitz Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.472)	(0,00)
(2.900)	Sotetsu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.195)	(0,00)
(14.918)	Spire Healthcare Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(27)	(0,00)
3.000	SPX Technologies Inc	Goldman Sachs International	(9.547)	(0,00)
(133.526)	SSAB AB Class B	Morgan Stanley	(1.996)	(0,00)
(50.264)	SSP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(13.250)	(0,00)
(32.713)	Stadler Rail AG	Goldman Sachs International	(3.859)	(0,00)
(22.704)	Standard Chartered plc	Bank of America Merrill Lynch	(7.227)	(0,00)
(75.887)	Stora Enso OYJ	Morgan Stanley	(1.747)	(0,00)
(300)	Strike Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(446)	(0,00)
900	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(987)	(0,00)
400	SUMCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(149)	(0,00)
500	Sumitomo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18)	(0,00)
800	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(0,00)
200	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(31)	(0,00)
(600)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(796)	(0,00)
(1.500)	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.735)	(0,00)
(100)	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(43)	(0,00)
(300)	Sundrug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.054)	(0,00)
500	Suzuki Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.446)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
6.455	Symrise AG	Morgan Stanley	(1.327)	(0,00)
414	Synthomer Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(0,00)
(2.400)	Systema Corp	Bank of America Merrill Lynch	(67)	(0,00)
(2.300)	T&D Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.333)	(0,00)
(3.600)	Tadano Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(274)	(0,00)
200	Taikisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(0,00)
(1.400)	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(776)	(0,00)
(600)	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(856)	(0,00)
1.900	Taiyo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.418)	(0,00)
(4.600)	Takara Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(174)	(0,00)
(1.100)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.824)	(0,00)
(100)	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(169)	(0,00)
127.551	Tate & Lyle Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.389)	(0,00)
293.208	Taylor Wimpey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.188)	(0,00)
(900)	TBS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(151)	(0,00)
100	TDK Corp	Bank of America Merrill Lynch	(199)	(0,00)
(2.400)	TechMatrix Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.053)	(0,00)
1.016	Telecom Plus Plc	Bank of America Merrill Lynch	(766)	(0,00)
45.871	Tesco Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.844)	(0,00)
4.734	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs International	(14.183)	(0,00)
50.610	THG Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6.152)	(0,00)
1.100	TIS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(853)	(0,00)
(1.700)	Toagosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.172)	(0,00)
1.300	Tobu Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(178)	(0,00)
(3.600)	Toda Corp	Bank of America Merrill Lynch	(108)	(0,00)
(3.100)	Toho Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.939)	(0,00)
(6.000)	Tohoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.646)	(0,00)
(6.300)	Tokai Carbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49)	(0,00)
(11.200)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.052)	(0,00)
(800)	Tokyo Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(114)	(0,00)
(500)	Tokyo Seimitsu Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(42)	(0,00)
3.000	Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(141)	(0,00)
3.800	Tokyo Tatemono Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.666)	(0,00)
(3.900)	Tokyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.012)	(0,00)
5.800	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(847)	(0,00)
(1.800)	Tomy Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(321)	(0,00)
1.200	TOPPAN Inc	Bank of America Merrill Lynch	(443)	(0,00)
(4.800)	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.377)	(0,00)
600	Toro Co	Goldman Sachs International	(906)	(0,00)
300	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(0,00)
(100)	Toyo Ink SC Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
(100)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)	(0,00)
1.200	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(503)	(0,00)
1.800	Toyoda Gosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.140)	(0,00)
900	Toyota Boshoku Corp	Bank of America Merrill Lynch	(277)	(0,00)
(2.604)	Trainline Plc	Bank of America Merrill Lynch	(140)	(0,00)
2.068	Travis Perkins Plc	Bank of America Merrill Lynch	(955)	(0,00)
400	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.067)	(0,00)
100	Tsumura & Co	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(0,00)
(400)	Tsuruha Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.752)	(0,00)
9.600	Two Harbors Investment Corp	Goldman Sachs International	(3.659)	(0,00)
(1.500)	UBE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(186)	(0,00)
6.000.000	UBS Group AG	Société Générale	(160.722)	(0,03)
(400)	Unicharm Corp	Bank of America Merrill Lynch	(510)	(0,00)
1.264	Unilever Plc	Bank of America Merrill Lynch	(729)	(0,00)
(100)	United Super Markets Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124)	(0,00)
9.080	Unum Group	Goldman Sachs International	(1.422)	(0,00)
(18.610)	UPM-Kymmene OYJ	Morgan Stanley	(567)	(0,00)
52.692	Urban Logistics REIT Plc	Bank of America Merrill Lynch	(478)	(0,00)
1.100	UT Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(248)	(0,00)
(86.116)	Valmet Oyj	Morgan Stanley	(5.338)	(0,00)
2.200	ValueCommerce Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.522)	(0,00)
2.800	Varex Imaging Corp	Goldman Sachs International	(2.798)	(0,00)
(24.682)	Vestas Wind Systems A/S	Morgan Stanley	(1.923)	(0,00)
3.810	Victrex Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.214)	(0,00)
2.100.000	Virgin Galactic Holdings Inc	Société Générale	(4.274)	(0,00)
(47.207)	Virgin Money UK Plc	Bank of America Merrill Lynch	(13.294)	(0,00)
13.331	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs International	(11.528)	(0,00)
22.850	Vitesco Technologies Group AG	Morgan Stanley	(5.746)	(0,00)
160.419	Vodafone Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16.035)	(0,00)
(4.170)	Volution Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(180)	(0,00)
(200)	Wacoal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(72)	(0,00)
2.400	Wacom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(708)	(0,00)
(298.044)	Wartsila OYJ Abp	Morgan Stanley	(2.899)	(0,00)
42.726	Weir Group Plc	Goldman Sachs International	(2.676)	(0,00)
30.000	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs International	(21.225)	(0,00)
(200)	West Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(382)	(0,00)
(100)	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(128)	(0,00)
(5.825)	WH Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.568)	(0,00)
(1.000)	Yamaha Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(293)	(0,00)
1.500	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.353)	(0,00)
16.150	Yara International ASA	Morgan Stanley	(581)	(0,00)

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,46 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
1.000	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(28)	(0,00)
4.800	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(337)	(0,00)
(600)	Zenkoku Hosho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(729)	(0,00)
500	Zensho Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(0,00)
(1.800)	Zeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(119)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b>			<b>(3.269.736)</b>	<b>(0,46)</b>

### Verkaufte Swaptions (0,00 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Beschreibung	Gegenpartei	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Call Swaptions</b>					
(120.000.000) EUR	18.01.2023	EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 120,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S38, strike 1.2%	JPMorgan Chase Bank	(20.738)	(0,00)
<b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Swaptions insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: 140.441 US\$)</b>				<b>(20.738)</b>	<b>(0,00)</b>

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,01 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
500.000 EUR	20.06.2027	ICE Clear U.S. <sup>1</sup>	Selling default protection on iTraxx Europe S37	(5.915)	(0,00)
500.000.000 JPY	20.06.2027	Nomura International Plc	Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(42.011)	(0,01)
<b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>‡</sup></b>				<b>(47.926)</b>	<b>(0,01)</b>

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,14 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup>	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
EUR 400.000.000	18.04.2023	Merrill Lynch International	Erhalt	2,41 %	1D EURIBOR	(13.217)	(0,00)
GBP 1.880.000.000	23.03.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,88 %	1D SONIA	(61.919)	(0,01)
USD 4.220.000	15.05.2038	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,24 %	12M SOFR	(128.996)	(0,02)
EUR 59.000.000	12.12.2024	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,19 %	1D EURIBOR	(129.785)	(0,02)
EUR 422.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,24 %	1D EURIBOR	(295.192)	(0,04)
EUR 422.000.000	20.12.2023	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,17 %	1D EURIBOR	(371.473)	(0,05)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b>						<b>(1.000.582)</b>	<b>(0,14)</b>

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Total Return Swap-Kontrakte (0,00 %)**

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
4.316.300 EUR	05.05.2023	0,00 <sup>1</sup>	UBS Basket UBSCFVPR <sup>2</sup>	(13.154)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>(13.154)</b>	<b>(0,00)</b>

<sup>1</sup> Fester Zinssatz.<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist UBS AG.**Inflation-Swap-Kontrakte (0,05 %)**

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation	Volatilität-Ausübungssatz	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
50.000 USD	08.12.2023	Goldman Sachs International	Nikkei 225 Index vs S&P 500 Index	Various	(2.241)	(0,00)
50.000 EUR	20.12.2024	BNP Paribas	BNP 5 Names EU Basket	Various	(30.225)	(0,00)
300.000 USD	20.12.2024	UBS AG	UBS 24 Names US Basket	Various	(299.753)	(0,05)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(332.219)</b>	<b>(0,05)</b>

**Volatility-Swap-Kontrakte (0,13 %)**

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation <sup>1</sup>	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
10.000.000 USD	20.01.2023	UBS	UBS 32 Names US Basket	(0)	(0,00)
30.000.000 USD	20.01.2023	Morgan Stanley	MS 13 Names US Basket	(7.581)	(0,00)
10.000.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 29 Names US Basket	(9.854)	(0,00)
7.500.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 39 Names US Basket	(12.338)	(0,00)
55.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 7 Names EU Down Geo Basket	(12.539)	(0,00)
25.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 7 Names EU Down Geo Basket	(12.831)	(0,00)
15.000.000 USD	16.06.2023	BNP	BNP 11 Names US Basket	(46.998)	(0,01)
30.000.000 EUR	15.12.2023	Bank of America Merrill Lynch	BAML 12 Names EU Basket	(50.370)	(0,01)
14.000.000 USD	15.09.2023	BNP	BNP Down Pairwise US Basket	(52.399)	(0,01)
1.000.000 EUR	19.01.2024	BNP	BNP 5 Names EU Basket	(67.636)	(0,01)
8.000.000 USD	16.06.2023	UBS	UBS 30 Names US Basket	(74.728)	(0,01)
4.000.000 USD	18.01.2023	UBS	Chinese Yuan Renminbi vs Mexican Peso Rate Basket	(100.018)	(0,01)
1.357.500.000 JPY	15.12.2023	SOG	Nikkei 225 Index Basket	(115.002)	(0,01)
30.000.000 EUR	21.06.2024	Bank of America Merrill Lynch	BAML 14 Names EU Basket	(122.842)	(0,02)
25.000.000 USD	16.06.2023	BNP	BNP 14 Names US Basket	(124.337)	(0,02)
25.000.000 USD	16.06.2023	BNP	BNP 17 Names US Basket	(130.468)	(0,02)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>(939.941)</b>	<b>(0,13)</b>

<sup>1</sup>Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.



## XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(59.324.225)</b>	<b>(8,34)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>539.367.206</b>	<b>75,76</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>172.575.504</b>	<b>24,24</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>711.942.710</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	22.794.046	2,85
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	459.663.159	57,51
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	12.999.361	1,63
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	43.910.640	5,49
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>539.367.206</b>	<b>67,48</b>

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 85,83 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 92,22 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
2.822	AbbVie Inc	456.063	1,45
4.364	Activision Blizzard Inc	334.064	1,06
1.862	Adobe Inc	626.619	1,99
18.212	Alphabet Inc Class A	1.606.845	5,11
15.029	Amazon.com Inc	1.262.436	4,01
2.786	Analog Devices Inc	456.988	1,45
15.106	Apple Inc	1.962.723	6,24
1.349	Atlassian Corp Class A	173.589	0,55
1.495	Avery Dennison Corp	270.595	0,86
8.198	Boston Scientific Corp	379.321	1,21
5.713	Brookfield Corp	179.731	0,57
3.867	CDW Corp	690.569	2,19
4.621	Chewy Inc Class A	171.347	0,54
4.341	CME Group Inc Class A	729.982	2,32
1.438	Costco Wholesale Corp	656.447	2,09
2.342	DoubleVerify Holdings Inc	51.430	0,16
3.055	Equifax Inc	593.770	1,89
1.466	Fidelity National Information Services Inc	99.468	0,32
1.655	Home Depot Inc	522.748	1,66
571	Intuit Inc	222.245	0,71
2.707	Johnson & Johnson	478.191	1,52
12.409	Keurig Dr Pepper Inc	442.505	1,41
2.116	Mastercard Inc Class A	735.797	2,34
1.916	McDonald's Corp	504.923	1,60
5.234	Meta Platforms Inc Class A	629.860	2,00
10.159	Microsoft Corp	2.436.331	7,74
1.010	Netflix Inc	297.829	0,95
7.527	NextEra Energy Inc	629.257	2,00
5.269	NIKE Inc Class B	616.526	1,96
1.183	NVIDIA Corp	172.884	0,55
3.135	Okta Inc Class A	214.214	0,68
14.291	Paycor HCM Inc	349.701	1,11
2.751	S&P Global Inc	921.420	2,93
5.282	Salesforce Inc	700.340	2,23
1.773	ServiceNow Inc	688.403	2,19
8.001	Sweetgreen Inc Class A	68.569	0,22
3.520	TE Connectivity Ltd	404.096	1,28
1.175	Thermo Fisher Scientific Inc	647.061	2,06
9.506	TJX Cos Inc	756.678	2,40

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 85,83 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 92,22 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
2.863	Uber Technologies Inc	70.802	0,22
2.854	Union Pacific Corp	590.978	1,88
2.158	UnitedHealth Group Inc	1.144.128	3,64
3.441	Visa Inc Class A	714.902	2,27
2.014	Walmart Inc	285.565	0,91
2.260	Walt Disney Co	196.349	0,62
3.309	Waste Management Inc	519.116	1,65
2.043	Workday Inc Class A	341.855	1,09
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>27.005.260</b>	<b>85,83</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften 1,52 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 1,58 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
1.708	SBA Communications Corp Class A	478.769	1,52
<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>		<b>478.769</b>	<b>1,52</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>27.484.029</b>	<b>87,35</b>

Devisenterminkontrakte 6,86 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
177.538.375 ¥	1.277.601 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	4	70.555	0,22
249.488.705 ¥	1.796.909 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	97.608	0,31
3.330.203.111 ¥	23.299.668 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	13	1.988.554	6,32
277.530 US\$	36.368.415 ¥	18.01.2023	UBS AG	1	1.363	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>2.158.080</b>	<b>6,86</b>

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>29.642.109</b>	<b>94,21</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,74 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen JPY</i>						
52.394.286 ¥	400.109 US\$	18.01.2023	Royal Bank of Canada	1	(2.248)	(0,01)
2.440.623 US\$	339.584.676 ¥	18.01.2023	Royal Bank of Canada	9	(138.047)	(0,44)
517.732 US\$	72.793.674 ¥	18.01.2023	UBS AG	2	(35.034)	(0,11)
4.378.546 US\$	625.546.422 ¥	18.01.2023	Westpac Banking Corp	14	(371.602)	(1,18)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(546.931)</b>	<b>(1,74)</b>

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(546.931)</b>	<b>(1,74)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>29.095.178</b>	<b>92,47</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>2.369.651</b>	<b>7,53</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>31.464.829</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	27.484.029	85,70
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.611.149	5,02
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>29.095.178</b>	<b>90,72</b>

## US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Staatsanleihen 92,92 % (31. Dezember 2021: 82,53 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
81.800.000	United States Treasury Note/Bond	0,13 %	15.09.2023	79.236.857	11,64
77.900.000	United States Treasury Note/Bond	0,13 %	15.12.2023	74.626.177	10,97
76.400.000	United States Treasury Note/Bond	0,25 %	15.06.2023	74.921.393	11,01
86.400.000	United States Treasury Note/Bond	0,25 %	15.03.2024	81.921.375	12,04
90.000.000	United States Treasury Note/Bond	0,25 %	15.06.2024	84.480.469	12,42
90.000.000	United States Treasury Note/Bond	0,38 %	15.09.2024	83.893.360	12,33
72.200.000	United States Treasury Note/Bond	0,50 %	15.03.2023	71.650.679	10,53
87.100.000	United States Treasury Note/Bond	1,00 %	15.12.2024	81.533.766	11,98
<b>Staatsanleihen insgesamt *</b>				<b>632.264.076</b>	<b>92,92</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>632.264.076</b>	<b>92,92</b>

Devisenterminkontrakte 2,44 % (31. Dezember 2021: 0,23 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
222.427 €	225.915 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	11.710	0,00
7.649.263 €	7.643.257 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	27	528.675	0,08
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
3.061.521 €	3.532.961 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	151.202	0,03
214.067.118 €	241.870.550 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	51	15.732.830	2,31
1.492.033 US\$	1.227.835 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	14.486	0,00
13.997.072 US\$	11.511.572 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	23	144.315	0,02
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
3.642 SGD	2.697 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	20	0,00
219.149 SGD	154.362 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	23	9.089	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten **</b>					<b>16.592.327</b>	<b>2,44</b>
					<b>Zeitwert % des Netto- US\$ vermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>648.856.403</b>	<b>95,36</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2021: (0,03 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
72.596 €	77.833 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(276)	(0,00)
52.686 €	56.324 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(38)	(0,00)
1.580.314 US\$	1.548.697 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	27	(74.202)	(0,01)

## US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2021: (0,03 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
10.665.651 £	13.055.398 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	33	(220.603)	(0,03)
6.271.837 US\$	5.551.432 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(408.627)	(0,06)
10.069.205 US\$	8.904.273 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	34	(645.990)	(0,10)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
2.072 SGD	1.548 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
831 US\$	1.166 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(38)	(0,00)
28.885 US\$	40.195 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	19	(1.094)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(1.350.871)</b>	<b>(0,20)</b>

### Verkaufte Optionskontrakte (1,90 %) (31. Dezember 2021: (0,78 %))

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen</b>				
(17)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,785	(34.595)	(0,01)
(3)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,785	(12.750)	(0,00)
(168)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,820	(547.680)	(0,08)
(2)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,820	(11.140)	(0,00)
(33)	27.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,820	(244.695)	(0,04)
(12)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,825	(41.640)	(0,01)
(84)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,835	(308.280)	(0,05)
(1)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,835	(5.960)	(0,00)
(371)	27.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,835	(2.895.655)	(0,43)
(6)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,845	(26.250)	(0,00)
(10)	27.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,845	(84.950)	(0,01)
(8)	27.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,850	(69.640)	(0,01)
(215)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,855	(1.540.475)	(0,23)
(10)	27.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,860	(91.750)	(0,01)
(211)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,895	(1.966.520)	(0,29)
(37)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,950	(424.020)	(0,06)
(23)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,955	(273.585)	(0,04)
(17)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,970	(225.080)	(0,03)
(3)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,970	(43.185)	(0,01)
(67)	06.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,975	(917.900)	(0,13)
(4)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,975	(59.180)	(0,01)
(5)	13.01.2023	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,020	(92.625)	(0,01)
(106)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,785	(537.950)	(0,08)
(138)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,825	(908.730)	(0,13)
(159)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,845	(1.189.320)	(0,17)
(6)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,855	(47.610)	(0,01)

## US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (1,90 %) (31. Dezember 2021: (0,78 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(34)	20.01.2023	S&P 500 Index, Strike Price \$3,890	(331.160)	(0,05)
<b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 15.187.733 US\$)</b>			<b>(12.932.325)</b>	<b>(1,90)</b>

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(14.283.196)</b>	<b>(2,10)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>634.573.207</b>	<b>93,26</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>45.883.531</b>	<b>6,74</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>680.456.738</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	632.264.076	90,55
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(12.932.325)	(1,85)
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	15.241.456	2,18
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>634.573.207</b>	<b>90,88</b>

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto- US\$ vermögens	
<b>Aktien 95,51 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 98,97 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
91.510	3M Co	10.973.879	0,62
51.050	Air Products & Chemicals Inc	15.736.673	0,89
158.843	Alcoa Corp	7.222.591	0,41
251.849	American Electric Power Co Inc	23.913.063	1,35
43.114	Aon Plc Class A	12.940.236	0,73
1.412.637	Bank of America Corp	46.786.537	2,65
118.687	Berkshire Hathaway Inc Class B	36.662.414	2,07
32.756	Biogen Inc	9.070.791	0,51
46.775	Boston Scientific Corp	2.164.279	0,12
422.253	Bristol-Myers Squibb Co	30.381.103	1,72
106.897	Caterpillar Inc	25.608.245	1,45
294.681	Chevron Corp	52.892.293	2,99
36.968	Cisco Systems Inc	1.761.156	0,10
218.740	Citigroup Inc	9.893.610	0,56
52.279	CME Group Inc Class A	8.791.237	0,50
160.916	ConocoPhillips	18.988.088	1,07
177.365	Constellation Brands Inc Class A	41.104.339	2,32
170.729	Cummins Inc	41.365.929	2,34
65.004	Danaher Corp	17.253.362	0,98
270.512	Delta Air Lines Inc	8.889.024	0,50
252.228	DTE Energy Co	29.644.357	1,68
298.618	Duke Energy Corp	30.754.668	1,74
48.398	Elevance Health Inc	24.826.722	1,40
228.316	Emerson Electric Co	21.932.035	1,24
38.853	Estee Lauder Cos Inc Class A	9.639.818	0,55
318.907	Exelon Corp	13.786.350	0,78
685.918	Exxon Mobil Corp	75.656.755	4,28
154.687	Fifth Third Bancorp	5.075.280	0,29
100.252	Franco-Nevada Corp	13.682.393	0,77
888.190	Freeport-McMoRan Inc	33.751.220	1,91
171.234	General Electric Co	14.347.697	0,81
45.262	Goldman Sachs Group Inc	15.542.066	0,88
83.968	Honeywell International Inc	17.994.342	1,02
55.371	Humana Inc	28.360.472	1,60
67.360	Intel Corp	1.780.325	0,10
118.989	International Business Machines Corp	16.764.360	0,95
253.048	Johnson & Johnson	44.700.929	2,53
269.908	Johnson Controls International Plc	17.274.112	0,98



## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 95,51 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
445.318	JPMorgan Chase & Co	59.717.144	3,38
665.551	Keurig Dr Pepper Inc	23.733.549	1,34
69.195	Lockheed Martin Corp	33.662.676	1,90
60.864	M&T Bank Corp	8.828.932	0,50
473.335	Merck & Co Inc	52.516.518	2,97
250.042	MetLife Inc	18.095.540	1,02
511.123	Mondelez International Inc Class A	34.066.348	1,93
240.067	Morgan Stanley	20.410.496	1,15
452.470	Mosaic Co	19.849.859	1,12
973.995	Newmont Corp	45.972.564	2,60
463.388	NextEra Energy Inc	38.739.237	2,19
67.133	Nucor Corp	8.848.801	0,50
219.610	Oracle Corp	17.950.921	1,02
72.789	Parker-Hannifin Corp	21.181.599	1,20
104.344	PepsiCo Inc	18.850.787	1,07
823.359	Pfizer Inc	42.188.915	2,39
247.456	Philip Morris International Inc	25.045.022	1,42
95.873	Phillips 66	9.978.462	0,56
246.839	PNC Financial Services Group Inc	38.985.752	2,21
319.567	Procter & Gamble Co	48.433.575	2,74
301.220	Raytheon Technologies Corp	30.399.122	1,72
18.775	Regeneron Pharmaceuticals Inc	13.545.975	0,77
763.643	Regions Financial Corp	16.464.143	0,93
582.458	Rio Tinto Plc ADR	41.471.010	2,35
235.621	Sempra Energy	36.412.869	2,06
91.718	State Street Corp	7.114.565	0,40
26.748	Thermo Fisher Scientific Inc	14.729.856	0,83
80.240	T-Mobile US Inc	11.233.600	0,64
416.451	Truist Financial Corp	17.919.887	1,01
102.593	United Airlines Holdings Inc	3.867.756	0,22
127.780	Walmart Inc	18.117.926	1,02
143.241	Walt Disney Co	12.444.778	0,70
309.964	Wheaton Precious Metals Corp	12.113.393	0,69
218.208	Zimmer Biomet Holdings Inc	27.821.520	1,57
	<b>Aktien insgesamt *</b>	<b>1.688.625.847</b>	<b>95,51</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>1.688.625.847</b>	<b>95,51</b>

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
3.888.194 €	3.877.309 US\$	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	5	276.563	0,02
3.429.922 €	3.410.482 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	3	253.804	0,01
9.111.483 €	9.293.547 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	61	440.513	0,03
983 US\$	920 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
779 £	898 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	2	40	0,00
81.894 £	95.825 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	11	2.727	0,00
2.903 US\$	2.383 £	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	35	0,00
4.582 US\$	3.761 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	55	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b>					<b>973.737</b>	<b>0,06</b>
					<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto-</b>
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>1.689.599.584</b>	<b>95,57</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2021: (0,00 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
111.854 €	119.925 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(428)	(0,00)
176.927 US\$	173.578 €	18.01.2023	JPMorgan Chase Bank	2	(8.511)	(0,00)
433.627 US\$	415.466 €	18.01.2023	Standard Chartered Bank	3	(10.228)	(0,00)
2.320.562 US\$	2.250.118 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	64	(83.302)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
1.475 £	1.812 US\$	18.01.2023	Standard Chartered Bank	1	(37)	(0,00)
2.225 £	2.718 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(40)	(0,00)
2.514 US\$	2.145 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(66)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b>					<b>(102.612)</b>	<b>(0,01)</b>
					<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto-</b>
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(102.612)</b>	<b>(0,01)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>1.689.496.972</b>	<b>95,56</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>78.457.387</b>	<b>4,44</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>1.767.954.359</b>	<b>100,00</b>

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	1.688.625.847	94,38
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	871.125	0,05
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>1.689.496.972</b>	<b>94,43</b>

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 71,33 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 86,01 %)</b>			
<b>Euro</b>			
10.679	Airbus SE	1.265.964	0,57
<b>Euro insgesamt</b>		<b>1.265.964</b>	<b>0,57</b>
<b>US-Dollar</b>			
9.428	AbbVie Inc	1.523.659	0,69
23.238	Activision Blizzard Inc	1.778.869	0,80
12.539	Adobe Inc	4.219.750	1,91
2.407	Air Products & Chemicals Inc	741.982	0,34
15.501	Alcoa Corp	704.830	0,32
45.838	Alphabet Inc Class A	4.044.287	1,83
55.672	Amazon.com Inc	4.676.448	2,11
23.649	Amphenol Corp Class A	1.800.635	0,81
16.177	Analog Devices Inc	2.653.513	1,20
29.029	Apollo Global Management Inc	1.851.760	0,84
49.738	Apple Inc	6.462.458	2,92
9.579	Asbury Automotive Group Inc	1.717.036	0,78
21.419	Ashland Inc	2.303.185	1,04
1.577	ASML Holding NV	861.673	0,39
3.006	Atlassian Corp Class A	386.812	0,17
9.953	Avery Dennison Corp	1.801.493	0,81
3.260	Becton Dickinson & Co	829.018	0,37
7.806	Boeing Co	1.486.965	0,67
29.445	Boston Scientific Corp	1.362.420	0,62
12.358	Brookfield Asset Management Ltd Class A	354.304	0,16
49.434	Brookfield Corp	1.555.194	0,70
11.010	CDW Corp	1.966.166	0,89
77.723	CenterPoint Energy Inc	2.330.913	1,05
13.821	Chevron Corp	2.480.731	1,12
26.275	Chewy Inc Class A	974.277	0,44
20.579	CME Group Inc Class A	3.460.565	1,56
4.134	Costco Wholesale Corp	1.887.171	0,85
9.400	Dollar Tree Inc	1.329.536	0,60
14.266	DoubleVerify Holdings Inc	313.281	0,14
52.713	Enbridge Inc	2.061.078	0,93
14.658	Equifax Inc	2.848.929	1,29
25.640	European Wax Center Inc Class A	319.218	0,14
6.797	Expedia Group Inc	595.417	0,27
26.269	Fidelity National Information Services Inc	1.782.352	0,80
26.801	First Watch Restaurant Group Inc	362.617	0,16
5.140	Floor & Decor Holdings Inc Class A	357.898	0,16

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 71,33 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 86,01 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
7.783	Fresh Market Escrow Inc	0	0,00
6.693	Home Depot Inc	2.114.051	0,95
3.454	Humana Inc	1.769.104	0,80
107.100	Independence Holdings Corp	1.077.426	0,49
589	Intuit Inc	229.251	0,10
13.429	Johnson & Johnson	2.372.233	1,07
17.568	JPMorgan Chase & Co	2.355.869	1,06
79.993	Keurig Dr Pepper Inc	2.852.550	1,29
5.168	Marriott International Inc Class A	769.463	0,35
7.702	Mastercard Inc Class A	2.678.216	1,21
11.816	Match Group Inc	490.246	0,22
14.166	McDonald's Corp	3.733.166	1,69
28.244	Meta Platforms Inc Class A	3.398.883	1,53
30.864	Microsoft Corp	7.401.804	3,34
18.068	Mondelez International Inc Class A	1.204.232	0,54
3.860	Netflix Inc	1.138.237	0,51
59.942	NextEra Energy Inc	5.011.151	2,26
15.175	NIKE Inc Class B	1.775.627	0,80
62.936	nVent Electric Plc	2.421.148	1,09
1.431	NVIDIA Corp	209.126	0,09
20.987	Okta Inc Class A	1.434.042	0,65
71.699	Paycor HCM Inc	1.754.474	0,79
13.893	Procter & Gamble Co	2.105.623	0,95
5.950	Progressive Corp	771.774	0,35
103.226	Repay Holdings Corp Class A	830.969	0,38
12.796	S&P Global Inc	4.285.892	1,94
30.254	Salesforce Inc	4.011.378	1,81
5.591	ServiceNow Inc	2.170.818	0,98
12.019	Splunk Inc	1.034.716	0,47
170.000	Sunlight Financial Holdings Inc	219.300	0,10
40.428	Sweetgreen Inc Class A	346.468	0,16
22.916	TE Connectivity Ltd	2.630.757	1,19
2.998	Thermo Fisher Scientific Inc	1.650.969	0,75
53.806	TJX Cos Inc	4.282.958	1,93
22.691	Uber Technologies Inc	561.148	0,25
22.024	Union Pacific Corp	4.560.510	2,06
8.011	UnitedHealth Group Inc	4.247.272	1,92
12.684	Visa Inc Class A	2.635.228	1,19
8.892	Walmart Inc	1.260.797	0,57
9.691	Walt Disney Co	841.954	0,38

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung			Zeitwert% des Netto-US\$ vermögens
<b>Aktien 71,33 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 86,01 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>				
15.386	Waste Management Inc			2.413.756 1,09
18.385	WEC Energy Group Inc			1.723.778 0,78
10.647	Workday Inc Class A			1.781.562 0,80
	<b>US-Dollar insgesamt</b>			<b>156.744.366 70,76</b>
	<b>Aktien insgesamt *</b>			<b>158.010.330 71,33</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften 0,79 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 0,76 %)</b>				
<b>US-Dollar</b>				
6.225	SBA Communications Corp Class A			1.744.930 0,79
	<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>			<b>1.744.930 0,79</b>
Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Fälligkeitsdatum		Zeitwert% des Netto-US\$ vermögens
<b>Participatory Notes 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)</b>				
<b>US-Dollar</b>				
3.000	OneSpaWorld Holdings Ltd	19.03.2024		3.750 0,00
	<b>Participatory Notes insgesamt **</b>			<b>3.750 0,00</b>
Kapitalbetrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Zeitwert% des Netto-US\$ vermögens
<b>Unternehmensanleihen 3,79 % (31. Dezember 2021: 1,25 %)</b>				
<b>US-Dollar</b>				
640.000	Activision Blizzard Inc**	2,50 %	15.09.2050	395.868 0,18
660.000	Alphabet Inc**	2,25 %	15.08.2060	375.010 0,17
915.000	Amazon.com Inc**	3,25 %	12.05.2061	631.207 0,28
988.365	Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC**	10,00 %	15.08.2026	706.681 0,32
390.833	Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC†	15,00 %	15.08.2025	374.025 0,17
857.192	Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC**	15,00 %	15.08.2025	820.329 0,37
710.000	Apple Inc**	2,85 %	05.08.2061	460.243 0,21
250.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	2,67 %	01.12.2026	222.423 0,10
550.000	Florida Power & Light Co*	2,88 %	04.12.2051	371.501 0,17
600.000	Johnson & Johnson*	2,45 %	01.09.2060	369.344 0,17
138.000	Mastercard Inc*	2,95 %	15.03.2051	98.371 0,04
685.000	Meta Platforms Inc**	4,65 %	15.08.2062	552.208 0,25
820.000	Microsoft Corp**	2,68 %	01.06.2060	524.504 0,24
125.000	nVent Finance Sarl**	4,55 %	15.04.2028	114.996 0,05
745.000	Oracle Corp*	3,85 %	01.04.2060	498.291 0,22
240.000	Oracle Corp*	6,90 %	09.11.2052	258.160 0,12
545.000	PepsiCo Inc**	2,75 %	21.10.2051	379.673 0,17
125.000	SBA Communications Corp**	3,88 %	15.02.2027	113.152 0,05
410.000	Uber Technologies Inc**	8,00 %	01.11.2026	412.243 0,19

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital- betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits- datum	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Unternehmensanleihen 3,79 % (31. Dezember 2021: 1,25 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
459.000	UnitedHealth Group Inc <sup>*</sup>	3,13 %	15.05.2060	313.536	0,14
600.000	Walmart Inc <sup>*</sup>	2,65 %	22.09.2051	408.683	0,18
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>8.400.448</b>	<b>3,79</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>168.159.458</b>	<b>75,91</b>

Devisenterminkontrakte 3,02 % (31. Dezember 2021: 0,07 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
2.195.517 €	2.286.531 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	59.004	0,03
541.422 €	565.945 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	12.473	0,00
88.826.349 €	88.347.440 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	48	6.548.346	2,96
68.608 US\$	64.219 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
5.754 £	6.706 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	218	0,00
292.410 £	329.093 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	22.786	0,01
333.047 £	377.107 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	23.673	0,01
49.743 US\$	40.720 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	741	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
4.017 SGD	2.975 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	21	0,00
5.209 SGD	3.744 US\$	18.01.2023	UBS AG	2	141	0,00
459.615 SGD	323.358 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	17	19.441	0,01
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b>					<b>6.686.844</b>	<b>3,02</b>

Futures-Kontrakte 0,21 % (31. Dezember 2021: 0,00 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
(14)	E-mini Russell 2000 Index Future March 2023	28.420	0,01
(17)	Nasdaq 100 E-mini Future March 2023	226.134	0,10
(40)	S&P 500 E-mini Future March 2023	215.700	0,10
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>		<b>470.254</b>	<b>0,21</b>

Differenzkontrakte 1,43 % (31. Dezember 2021: 0,37 %)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
448.047	3M Co	Goldman Sachs International	138.621	0,06
374.923	AeroVironment Inc	JPMorgan Chase Bank	10.378	0,00
142.299	AeroVironment Inc	Goldman Sachs International	23.775	0,01
234.042	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs International	35.569	0,02

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 1,43 % (31. Dezember 2021: 0,37 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter % des Netto- Gewinn US\$ vermögens	
407.583	AutoNation Inc	Goldman Sachs International	47.651	0,02
454.687	Best Buy Co Inc	JPMorgan Chase Bank	2.952	0,00
289.890	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	9.246	0,00
308.977	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Goldman Sachs International	33.089	0,02
84.183	BRC Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	5.969	0,00
535.198	Canadian Pacific Railway Ltd	JPMorgan Chase Bank	12.709	0,01
720.378	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs International	34.632	0,02
763.994	CarMax Inc	Goldman Sachs International	234.569	0,11
12.377	Carvana Co	JPMorgan Chase Bank	2.021	0,00
135.449	Children's Place Inc	Goldman Sachs International	2.943	0,00
675.995	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs International	27.571	0,01
360.700	Coinbase Global Inc Class A	Goldman Sachs International	88.985	0,04
114.623	Confluent Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	3.708	0,00
347.139	Confluent Inc Class A	Goldman Sachs International	28.262	0,01
616.288	Consolidated Edison Inc	JPMorgan Chase Bank	10.723	0,01
89.607	Cricut Inc Class A	Goldman Sachs International	3.921	0,00
351.955	Darden Restaurants Inc	JPMorgan Chase Bank	11.239	0,01
121.369	Datadog Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	7.544	0,00
125.654	Datadog Inc Class A	Goldman Sachs International	14.004	0,01
206.974	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs International	14.203	0,01
65.070	Dine Brands Global Inc	JPMorgan Chase Bank	3.823	0,00
404.142	Expeditors International of Washington Inc	JPMorgan Chase Bank	20.147	0,01
732.628	First Republic Bank	Goldman Sachs International	44.643	0,02
248.519	Ford Motor Co	Goldman Sachs International	37.376	0,02
40.090	Fubotv Inc	JPMorgan Chase Bank	14.734	0,01
56.276	Fubotv Inc	Goldman Sachs International	39.484	0,02
332.095	General Electric Co	Goldman Sachs International	26.434	0,01
72.313	Grocery Outlet Holding Corp	JPMorgan Chase Bank	1.161	0,00
266.538	Grocery Outlet Holding Corp	Goldman Sachs International	71.773	0,03
618.836	Hain Celestial Group Inc	Goldman Sachs International	112.158	0,05
328.306	HubSpot Inc	JPMorgan Chase Bank	11.363	0,01
443.124	iHeartMedia Inc Class A	Goldman Sachs International	110.561	0,05
443.848	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	23.059	0,01
763.444	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	35.015	0,02
762.534	Invesco Ltd	JPMorgan Chase Bank	42.787	0,02
762.689	Iron Mountain Inc	JPMorgan Chase Bank	63.939	0,03
679.059	Lamar Advertising Co Class A	JPMorgan Chase Bank	18.254	0,01
109.250	Lucid Group Inc	JPMorgan Chase Bank	10.502	0,00
178.187	McCormick & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	3.352	0,00
244.501	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs International	11.442	0,01
62.879	Mister Car Wash Inc	JPMorgan Chase Bank	2.775	0,00



## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 1,43 % (31. Dezember 2021: 0,37 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter % des Netto- Gewinn US\$ vermögens	
314.745	Outfront Media Inc	Goldman Sachs International	3.254	0,00
501.294	Packaging Corp of America	Goldman Sachs International	35.788	0,02
39.564	Packaging Corp of America	JPMorgan Chase Bank	1.491	0,00
347.596	Palantir Technologies Inc Class A	Goldman Sachs International	89.897	0,04
39.869	Paycom Software Inc	JPMorgan Chase Bank	587	0,00
1.079.926	Paycom Software Inc	Goldman Sachs International	73.741	0,03
902.002	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs International	84.898	0,04
185.921	Robinhood Markets Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	12.847	0,01
473.951	ROBLOX Corp Class A	Goldman Sachs International	102.994	0,05
252.765	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs International	19.705	0,01
310.565	Sirius XM Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	8.123	0,00
245.731	Snowflake Inc Class A	Goldman Sachs International	24.224	0,01
222.764	Sonic Automotive Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	867	0,00
116.047	Steelcase Inc Class A	Goldman Sachs International	50.194	0,02
834.488	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	91.576	0,04
422.025	T Rowe Price Group Inc	JPMorgan Chase Bank	10.317	0,00
554.184	Texas Instruments Inc	JPMorgan Chase Bank	15.706	0,01
175.272	TopBuild Corp	Goldman Sachs International	62.386	0,03
620.771	Trade Desk Inc Class A	Goldman Sachs International	170.899	0,08
212.511	Trade Desk Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	9.052	0,00
353.081	Transunion	Goldman Sachs International	7.208	0,00
59.438	Upstart Holdings Inc	Goldman Sachs International	30.574	0,01
149.328	Upstart Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	26.529	0,01
1.053.606	ViacomCBS Inc Class B	Goldman Sachs International	382.644	0,17
636.293	Warner Bros Discovery Inc	Goldman Sachs International	153.153	0,07
79.983	Warner Bros Discovery Inc	JPMorgan Chase Bank	4.621	0,00
749.609	Western Union Co	Goldman Sachs International	180.387	0,08
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b>			<b>3.162.728</b>	<b>1,43</b>

### Total Return Swap-Kontrakte 0,30 % (31. Dezember 2021: 0,15 %)

	Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter % des Netto- Gewinn US\$ vermögens	
USD	(7.258.428)	23.05.2023	4,36 <sup>1</sup>	JPMorgan Basket JPNBLQGS <sup>2</sup>	425.028	0,19
USD	(590.362)	23.05.2023	3,35 <sup>3</sup>	Goldman Sachs GSNBLIPO Index <sup>4</sup>	112.691	0,05
USD	(3.148.067)	01.05.2023	3,68 <sup>1</sup>	JPMorgan Basket JPNBGCND <sup>2</sup>	87.019	0,04
EUR	(384.065)	07.07.2023	1,51 <sup>5</sup>	Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>	20.180	0,01
EUR	(672.634)	07.07.2023	1,51 <sup>5</sup>	Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>	11.140	0,01
EUR	(1.311.364)	07.07.2023	1,51 <sup>5</sup>	Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>4</sup>	8.348	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>664.406</b>	<b>0,30</b>

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Total Return Swap-Kontrakte 0,30 % (31. Dezember 2021: 0,15 %) (Fortsetzung)

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Bank Funding Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

<sup>3</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Fed Funds Effective Rate.

<sup>4</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Euro Short Term Rate (ESTR).

	Zeitwert % des Netto-
	US\$ vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>179.143.690 80,87</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,37 %) (31. Dezember 2021: (0,88 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
505.862 €	542.352 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(1.925)	(0,00)
496.291 €	530.556 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(354)	(0,00)
1.769.394 US\$	1.728.102 €	18.01.2023	UBS AG	2	(76.788)	(0,04)
13.968.006 US\$	13.760.957 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	80	(733.227)	(0,33)
<i>Abgesicherte Klassen GBP</i>						
17.567 £	21.509 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	(368)	(0,00)
3.654 US\$	3.295 £	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(311)	(0,00)
56.266 US\$	49.631 £	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	(3.459)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
2.028 SGD	1.515 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
1.681 US\$	2.358 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(78)	(0,00)
3.851 US\$	5.416 SGD	18.01.2023	UBS AG	3	(188)	(0,00)
109.624 US\$	155.144 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	(6.090)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(822.791)</b>	<b>(0,37)</b>

### Verkaufte Optionskontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2021: (0,04 %))

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Kaufoptionen</b>				
(55)	17.02.2023	Ashland Global Holdings Inc, Strike Price \$120	(5.638)	(0,00)
(46)	20.01.2023	Floor & Decor Holdings Inc, Strike Price \$90	(552)	(0,00)
(51)	20.01.2023	Marriott International Inc, Strike Price \$180	(510)	(0,00)
(214)	20.01.2023	Sweetgreen Inc, Strike Price \$18	0	(0,00)
(182)	20.01.2023	Sweetgreen Inc, Strike Price \$25	(910)	(0,00)
<b>Verkaufsoptionen</b>				
(84)	20.01.2023	CarMax Inc, Strike Price \$50	(2.310)	(0,00)
(200)	20.01.2023	Match Group Inc, Strike Price \$40	(30.200)	(0,01)

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2021: (0,04 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>				
(214)	20.01.2023	Sweetgreen Inc, Strike Price \$10	(34.240)	(0,02)
<b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 86.752 US\$)</b>			<b>(74.360)</b>	<b>(0,03)</b>

### Differenzkontrakte (0,58 %) (31. Dezember 2021: (0,48 %))

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
520.971	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs International	(84.510)	(0,04)
69.748	Bill.com Holdings Inc	Goldman Sachs International	(3.556)	(0,00)
155.780	Burlington Stores Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.260)	(0,01)
493.088	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs International	(192.089)	(0,09)
99.387	Campbell Soup Co	JPMorgan Chase Bank	(71)	(0,00)
776.215	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	(200.079)	(0,09)
240.287	Children's Place Inc	JPMorgan Chase Bank	(15.799)	(0,01)
360.912	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs International	(52.260)	(0,02)
22.837	Cricut Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(393)	(0,00)
75.770	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs International	(10.336)	(0,01)
276.966	Descartes Systems Group	Goldman Sachs International	(31.272)	(0,02)
355.114	DocuSign Inc	Goldman Sachs International	(52.873)	(0,02)
310.578	Emerson Electric Co	Goldman Sachs International	(69.662)	(0,03)
254.422	General Mills Inc	Goldman Sachs International	(70.350)	(0,03)
698.712	H&R Block Inc	Goldman Sachs International	(60.350)	(0,03)
58.741	Hawaiian Electric Industries Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.085)	(0,00)
177.861	Hawaiian Electric Industries Inc	Goldman Sachs International	(43.097)	(0,02)
666.624	Illinois Tool Works Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.066)	(0,00)
406.817	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs International	(50.423)	(0,02)
454.940	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs International	(57.970)	(0,03)
166.258	Interpublic Group of Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.628)	(0,00)
62.593	Iron Mountain Inc	Goldman Sachs International	(8.044)	(0,00)
469.985	Lamar Advertising Co Class A	Goldman Sachs International	(10.184)	(0,01)
248.557	Landstar System Inc	Goldman Sachs International	(28.939)	(0,01)
106.889	Omnicom Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.378)	(0,00)
934.882	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	(26.559)	(0,01)
278.782	SAP SE	Goldman Sachs International	(73.875)	(0,03)
68.397	Sonic Automotive Inc Class A	Goldman Sachs International	(6.325)	(0,00)
462.958	Southern Co	Goldman Sachs International	(19.632)	(0,01)
276.925	Southern Co	JPMorgan Chase Bank	(4.152)	(0,00)
371.168	SPS Commerce Inc	Goldman Sachs International	(90.893)	(0,04)
21.985	Steelcase Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.676)	(0,00)

## US Long Short Equity – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,58 %) (31. Dezember 2021: (0,48 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
32.193	Western Union Co	JPMorgan Chase Bank	(25)	(0,00)
<b>Gesamtverlust aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b>			<b>(1.291.811)</b>	<b>(0,58)</b>

### Total Return Swap-Kontrakte 0,32 % (31. Dezember 2021: (2,90 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens	
EUR	(386.926)	07.07.2023	1,51 <sup>1</sup>	Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>2</sup>	(59.270)	(0,03)
EUR	(594.984)	07.07.2023	1,51 <sup>1</sup>	Goldman Sachs GSCBECS1 Index <sup>2</sup>	(98.057)	(0,05)
USD	(6.024.258)	06.11.2023	4,32 <sup>3</sup>	JPMorgan Basket JPNBRMV3 <sup>4</sup>	(160.953)	(0,07)
USD	(9.628.309)	04.11.2023	4,48 <sup>3</sup>	S&P 500 Equal Weight Total Return Index <sup>4</sup>	(163.264)	(0,07)
USD	(4.380.446)	19.01.2024	3,93 <sup>5</sup>	Goldman Sachs GSCBOEC1 Index <sup>2</sup>	(219.357)	(0,10)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b>				<b>(700.901)</b>	<b>(0,32)</b>	

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Euro Short Term Rate (ESTR).

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>3</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Bank Funding Rate.

<sup>4</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

<sup>5</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Fed Funds Effective Rate.

	Zeitwert US\$	% des Nettovermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(2.889.863)</b>	<b>(1,30)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>176.253.827</b>	<b>79,57</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>45.276.074</b>	<b>20,43</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>221.529.901</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	162.073.146	68,90
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	5.712.287	2,43
† Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	374.025	0,16
± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	395.894	0,17
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	7.698.475	3,27
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>176.253.827</b>	<b>74,93</b>

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 99,48 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 100,07 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
188.300	Alphabet Inc Class C	16.707.859	3,79
100.400	Amazon.com Inc	8.433.600	1,91
135.800	Apollo Global Management Inc	8.662.682	1,96
119.000	Apple Inc	15.461.670	3,50
392.500	Aramark	16.225.950	3,68
141.000	Ball Corp	7.210.740	1,63
37.000	Becton Dickinson & Co	9.409.100	2,13
76.000	Berkshire Hathaway Inc Class B	23.476.400	5,32
136.700	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	9.044.072	2,05
1.900	Booking Holdings Inc	3.829.032	0,87
103.825	Brookfield Asset Management Ltd Class A	2.976.663	0,67
415.300	Brookfield Corp	13.065.338	2,96
196.200	Brookfield Renewable Corp Class A	5.403.348	1,22
31.000	Brunswick Corp	2.234.480	0,51
133.700	Charles Schwab Corp	11.131.862	2,52
52.000	Chubb Ltd	11.471.200	2,60
66.300	Columbia Sportswear Co	5.806.554	1,32
473.800	CSX Corp	14.678.324	3,33
14.500	Deere & Co	6.217.020	1,41
34.000	Dollar Tree Inc	4.808.960	1,09
65.000	Eagle Materials Inc	8.635.250	1,96
37.000	Electronic Arts Inc	4.520.660	1,02
748.600	Graphic Packaging Holding Co	16.656.350	3,77
72.000	HCA Healthcare Inc	17.277.120	3,92
71.200	Intercontinental Exchange Inc	7.304.408	1,66
100.200	JPMorgan Chase & Co	13.436.820	3,04
38.100	Lamb Weston Holdings Inc	3.404.616	0,77
44.500	Lowe's Cos Inc	8.866.180	2,01
39.900	McDonald's Corp	10.514.847	2,38
65.600	Microsoft Corp	15.732.192	3,57
145.200	Mondelez International Inc Class A	9.677.580	2,19
61.000	Motorola Solutions Inc	15.720.310	3,56
69.000	NIKE Inc Class B	8.073.690	1,83
40.300	Nordson Corp	9.580.116	2,17
211.300	Pfizer Inc	10.827.012	2,45
40.200	QUALCOMM Inc	4.419.588	1,00
154.200	Raytheon Technologies Corp	15.561.864	3,53
24.000	Rockwell Automation Inc	6.181.680	1,40
30.000	Sherwin-Williams Co	7.119.900	1,61

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 99,48 % (Freitag, 31. Dezember 2021: 100,07 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
105.000	Simply Good Foods Co	3.993.150	0,91
92.200	TJX Cos Inc	7.339.120	1,66
92.200	T-Mobile US Inc	12.908.000	2,93
338.300	US Foods Holding Corp	11.508.966	2,61
63.900	Walt Disney Co	5.551.632	1,26
12.600	WD-40 Co	2.031.246	0,46
59.400	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	5.928.714	1,34
<b>Aktien insgesamt *</b>		<b>439.025.865</b>	<b>99,48</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>439.025.865</b>	<b>99,48</b>

Devisenterminkontrakte 0,62 % (31. Dezember 2021: 0,05 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- vermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
352.821 AUD	225.211 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	7	14.197	0,00
158.704 AUD	104.145 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	3.546	0,00
6.215.286 AUD	4.035.372 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	42	182.058	0,04
19.506 US\$	28.713 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	22	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
850.661 €	873.091 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	35.695	0,01
184.300 €	188.176 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	8.717	0,00
8.838.321 €	8.890.296 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	32	551.941	0,13
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
1.386.164 SGD	999.294 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	34.565	0,01
1.489.074 SGD	1.068.842 US\$	18.01.2023	UBS AG	4	41.771	0,01
28.656.505 SGD	20.235.954 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	77	1.137.267	0,26
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
185.905 US\$	3.159.101 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	474	0,00
6.427 US\$	108.947 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	4	33	0,00
197.721.824 ZAR	11.012.081 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	13	593.663	0,13
16.870.397 ZAR	940.375 US\$	18.01.2023	UBS AG	7	49.872	0,01
35.420.646 ZAR	1.996.775 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	59	82.321	0,02
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten **</b>					<b>2.736.142</b>	<b>0,62</b>
					<b>Zeitwert US\$</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>441.762.007</b>	<b>100,10</b>

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,13 %) (31. Dezember 2021: (0,13 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
104.167 AUD	71.310 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(627)	(0,00)
86.965 AUD	59.307 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(295)	(0,00)
316.762 US\$	482.008 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	10	(10.309)	(0,00)
37.803 US\$	57.011 AUD	18.01.2023	UBS AG	2	(882)	(0,00)
2.032.893 US\$	3.138.515 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	26	(96.772)	(0,02)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
118.710 €	127.273 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(452)	(0,00)
46.073 €	49.251 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(30)	(0,00)
372.972 US\$	369.751 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(22.044)	(0,01)
124.935 US\$	118.635 €	18.01.2023	UBS AG	2	(1.806)	(0,00)
1.768.422 US\$	1.722.156 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	30	(71.408)	(0,02)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
375.335 SGD	280.425 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(485)	(0,00)
97.772 US\$	137.133 SGD	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(4.508)	(0,00)
1.018.597 US\$	1.431.910 SGD	18.01.2023	UBS AG	6	(49.381)	(0,01)
4.112.640 US\$	5.696.568 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	51	(136.097)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
950.634 US\$	17.027.545 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	7	(48.837)	(0,01)
719.525 US\$	12.531.924 ZAR	18.01.2023	UBS AG	4	(16.066)	(0,00)
2.798.042 US\$	49.839.466 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	55	(127.402)	(0,03)
3.158 ZAR	187 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(587.402)</b>	<b>(0,13)</b>
					<b>Zeitwert</b>	<b>% des Netto-</b>
					<b>US\$</b>	<b>vermögens</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(587.402)</b>	<b>(0,13)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>441.174.605</b>	<b>99,97</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>141.345</b>	<b>0,03</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>441.315.950</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>					<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind					439.025.865	98,39
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente					2.148.740	0,48
<b>Anlagen insgesamt</b>					<b>441.174.605</b>	<b>98,87</b>

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Aktien	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert% des Netto-US\$ vermögens	
<b>Immobilienaktiengesellschaften 96,38 % (31. Dezember 2021: 97,64 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
334.394	American Homes 4 Rent Class A	10.078.635	1,56
267.584	American Tower Corp	56.690.346	8,75
488.324	Apartment Income REIT Corp	16.754.396	2,59
132.293	Boston Properties Inc	8.940.361	1,38
290.683	Crown Castle Inc	39.428.242	6,08
224.425	Digital Realty Trust Inc	22.503.095	3,47
65.550	EastGroup Properties Inc	9.705.333	1,50
32.148	Equinix Inc	21.057.904	3,25
211.029	Equity LifeStyle Properties Inc	13.632.473	2,10
308.005	Equity Residential	18.172.295	2,80
90.401	Essex Property Trust Inc	19.157.780	2,96
115.426	Extra Space Storage Inc	16.988.399	2,62
522.329	Healthpeak Properties Inc	13.094.788	2,02
453.447	Invitation Homes Inc	13.440.169	2,07
388.295	Iron Mountain Inc	19.356.506	2,99
922.453	Kimco Realty Corp	19.537.555	3,02
58.909	Life Storage Inc	5.802.537	0,90
1.018.096	Medical Properties Trust Inc	11.341.589	1,75
461.535	Prologis Inc	52.028.841	8,03
145.758	Public Storage	40.839.934	6,30
423.652	Realty Income Corp	26.872.246	4,15
114.192	Regency Centers Corp	7.137.000	1,10
433.228	Retail Opportunity Investments Corp	6.511.417	1,00
205.721	Rexford Industrial Realty Inc	11.240.595	1,73
64.179	SBA Communications Corp Class A	17.990.015	2,78
166.141	Simon Property Group Inc	19.518.245	3,01
191.368	Spirit Realty Capital Inc	7.641.324	1,18
128.363	Sun Communities Inc	18.355.909	2,83
319.719	UDR Inc	12.382.717	1,91
394.032	Ventas Inc	17.751.142	2,74
353.213	VICI Properties Inc	11.444.101	1,77
403.303	Welltower Inc	26.436.512	4,08
409.648	Weyerhaeuser Co	12.699.088	1,96
<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>		<b>624.531.489</b>	<b>96,38</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>624.531.489</b>	<b>96,38</b>

Devisenterminkontrakte 0,63 % (31. Dezember 2021: 0,08 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
3.569.555 AUD	2.297.007 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	9	125.144	0,02



## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,63 % (31. Dezember 2021: 0,08 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i>						
1.295.450 AUD	845.721 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	33.317	0,01
29.193.020 AUD	18.971.759 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	57	837.407	0,13
108.564 US\$	159.412 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	394	0,00
1.116.569 US\$	1.639.425 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	9	4.124	0,00
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
50.507 CHF	53.759 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	918	0,00
106.883 CHF	113.863 US\$	18.01.2023	UBS AG	5	1.845	0,00
2.567.303 CHF	2.635.348 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	15	143.938	0,02
22.813 US\$	21.024 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	53	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
1.245.618 €	1.266.953 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	63.777	0,01
147.538 €	151.721 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	5.898	0,00
16.992.638 €	16.963.047 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	55	1.190.687	0,18
11 US\$	10 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
3.312.133 HKD	422.335 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	2.180	0,00
10.346.700 HKD	1.320.952 US\$	18.01.2023	UBS AG	6	5.182	0,00
74.662.933 HKD	9.528.210 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	26	41.329	0,01
239.547 US\$	1.863.953 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	644	0,00
144.126 US\$	1.121.939 HKD	18.01.2023	UBS AG	2	327	0,00
537.781 US\$	4.186.257 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	8	1.230	0,00
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
43.917 SGD	32.220 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	536	0,00
54.107 SGD	38.683 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	1.672	0,00
1.023.965 SGD	722.511 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	35	41.207	0,01
0 US\$	0 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
250.433 US\$	4.246.128 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	1.197	0,00
60.126 US\$	1.016.749 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	445	0,00
467.777.043 ZAR	26.076.610 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	15	1.380.657	0,21
23.533.143 ZAR	1.317.114 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	64.219	0,01
61.631.254 ZAR	3.476.279 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	48	141.313	0,02
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>™</sup></b>					<b>4.089.640</b>	<b>0,63</b>
					<b>Zeitwert % des Nettovermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>628.621.129</b>	<b>97,01</b>

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2021: (0,37 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
1.259.841 AUD	861.636 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	3	(6.760)	(0,00)
565.643 AUD	385.755 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(1.933)	(0,00)
2.389.158 US\$	3.643.673 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	8	(83.286)	(0,01)
508.574 US\$	758.741 AUD	18.01.2023	UBS AG	1	(6.276)	(0,00)
3.868.510 US\$	5.991.870 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	51	(197.322)	(0,03)
<i>Abgesicherte Klassen CHF</i>						
42.321 CHF	45.995 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(179)	(0,00)
38.705 CHF	42.025 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	(124)	(0,00)
16.097 US\$	15.092 CHF	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(241)	(0,00)
145.431 US\$	136.165 CHF	18.01.2023	UBS AG	5	(1.978)	(0,00)
770.457 US\$	751.255 CHF	18.01.2023	Westpac Banking Corp	18	(42.829)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
235.282 €	252.254 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(895)	(0,00)
256.846 €	274.579 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(183)	(0,00)
1.136.023 US\$	1.118.182 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	5	(58.564)	(0,01)
219.308 US\$	207.484 €	18.01.2023	UBS AG	2	(2.353)	(0,00)
6.177.443 US\$	6.128.123 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	63	(369.410)	(0,06)
<i>Abgesicherte Klassen HKD</i>						
1.320.058 HKD	169.330 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(138)	(0,00)
2.375.500 HKD	305.325 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	(857)	(0,00)
1.520.411 HKD	195.350 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	11	(479)	(0,00)
914.685 US\$	7.165.434 HKD	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(3.708)	(0,00)
373.014 US\$	2.918.407 HKD	18.01.2023	UBS AG	3	(1.038)	(0,00)
1.586.718 US\$	12.440.368 HKD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	20	(7.764)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen SGD</i>						
16.680 SGD	12.462 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(22)	(0,00)
42.546 US\$	59.417 SGD	18.01.2023	UBS AG	4	(1.770)	(0,00)
195.203 US\$	271.728 SGD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	31	(7.461)	(0,00)
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
2.893.135 US\$	51.712.750 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	7	(142.266)	(0,02)
1.980.132 US\$	34.199.077 ZAR	18.01.2023	UBS AG	4	(27.262)	(0,01)
5.459.435 US\$	97.523.290 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	72	(264.923)	(0,04)
55.002 ZAR	3.239 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	2	(11)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(1.230.032)</b>	<b>(0,19)</b>
					<b>Zeitwert % des Nettovermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					<b>(1.230.032)</b>	<b>(0,19)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>					<b>627.391.097</b>	<b>96,82</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>					<b>20.634.698</b>	<b>3,18</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>					<b>648.025.795</b>	<b>100,00</b>

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	624.531.489	95,19
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	2.859.608	0,44
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>627.391.097</b>	<b>95,63</b>

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Aktien	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,70 % (31. Dezember 2021: 98,77 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
23.321	AAON Inc*	1.756.538	0,30
174.540	Abcam Plc ADR*	2.715.842	0,46
41.247	Advanced Energy Industries Inc*	3.538.168	0,60
169.790	American Software Inc Class A*	2.492.517	0,42
55.286	AMERISAFE Inc*	2.873.213	0,48
43.981	AptarGroup Inc*	4.837.030	0,82
48.728	Artisan Partners Asset Management Inc Class A*	1.447.222	0,24
49.904	Asbury Automotive Group Inc*	8.945.292	1,51
37.464	Aspen Technology Inc*	7.695.106	1,30
8.785	Atrion Corp*	4.914.768	0,83
96.757	Bank of Hawaii Corp*	7.504.473	1,27
143.205	Bio-Techne Corp*	11.868.830	2,00
55.866	BOK Financial Corp*	5.798.332	0,98
43.915	Bright Horizons Family Solutions Inc*	2.771.036	0,47
5.809	Cable One Inc*	4.135.195	0,70
36.373	Cactus Inc Class A*	1.828.107	0,31
86.313	Certara Inc*	1.387.050	0,23
45.322	Chase Corp*	3.909.476	0,66
22.710	Chemed Corp*	11.591.865	1,96
57.821	Church & Dwight Co Inc*	4.660.951	0,79
97.389	Community Bank System Inc*	6.130.638	1,03
49.139	CommVault Systems Inc*	3.087.895	0,52
12.866	CRA International Inc*	1.575.184	0,27
52.006	CSW Industrials Inc*	6.029.056	1,02
64.609	Cullen/Frost Bankers Inc*	8.638.223	1,46
221.458	CVB Financial Corp*	5.702.544	0,96
197.254	Driven Brands Holdings Inc*	5.387.007	0,91
60.002	Eagle Materials Inc*	7.971.266	1,35
64.410	Element Solutions Inc*	1.171.618	0,20
17.097	ESAB Corp*	802.191	0,14
106.709	Exponent Inc*	10.573.795	1,78
18.614	Fair Isaac Corp*	11.141.968	1,88
123.463	First Financial Bankshares Inc*	4.247.127	0,72
69.441	FirstService Corp*	8.509.995	1,44
63.636	Floor & Decor Holdings Inc Class A*	4.430.975	0,75
110.747	FormFactor Inc*	2.461.906	0,42
60.813	Forward Air Corp*	6.378.676	1,08
103.406	Fox Factory Holding Corp*	9.433.729	1,59
50.393	FTI Consulting Inc*	8.002.408	1,35

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,70 % (31. Dezember 2021: 98,77 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
166.054	Glacier Bancorp Inc*	8.206.389	1,39
80.898	Graco Inc*	5.441.199	0,92
94.257	Grocery Outlet Holding Corp*	2.751.362	0,46
132.082	Haemonetics Corp*	10.388.249	1,75
70.236	Hagerty Inc Class A*	590.685	0,10
30.319	Hamilton Lane Inc Class A*	1.936.778	0,33
354.860	Hayward Holdings Inc*	3.335.684	0,56
215.788	Hillman Solutions Corp*	1.555.832	0,26
44.396	Houlihan Lokey Inc Class A*	3.869.555	0,65
22.637	ICON Plc*	4.397.237	0,74
8.829	IDEXX Laboratories Inc*	3.601.879	0,61
35.591	Jack Henry & Associates Inc*	6.248.356	1,05
38.515	Kadant Inc*	6.841.419	1,15
136.392	Kirby Corp*	8.776.825	1,48
59.043	Lakeland Financial Corp*	4.308.368	0,73
201.359	Lattice Semiconductor Corp*	13.064.172	2,21
49.255	LCI Industries*	4.553.625	0,77
40.025	Lindsay Corp*	6.518.071	1,10
38.848	Littelfuse Inc*	8.554.330	1,44
91.453	Manhattan Associates Inc*	11.102.394	1,87
14.024	MarketAxess Holdings Inc*	3.911.153	0,66
96.460	Matador Resources Co*	5.521.370	0,93
67.970	MKS Instruments Inc*	5.759.098	0,97
116.994	Model N Inc*	4.745.277	0,80
92.496	National Instruments Corp*	3.413.102	0,58
225.995	NetScout Systems Inc*	7.347.097	1,24
65.301	Nexstar Media Group Inc Class A*	11.429.634	1,93
27.315	Nordson Corp*	6.493.322	1,10
49.628	Novanta Inc*	6.742.956	1,14
70.018	Oceaneering International Inc*	1.224.615	0,21
25.810	Omega Flex Inc*	2.408.589	0,41
44.405	Pool Corp*	13.424.964	2,27
137.447	Power Integrations Inc*	9.857.699	1,66
83.457	Prosperity Bancshares Inc*	6.065.655	1,02
32.336	Quaker Chemical Corp*	5.396.878	0,91
82.216	Qualys Inc*	9.227.102	1,56
49.356	RBC Bearings Inc*	10.332.679	1,74
116.393	Richelieu Hardware Ltd**	3.110.514	0,52
48.940	RLI Corp*	6.424.354	1,08
120.445	Rollins Inc*	4.401.060	0,74

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 97,70 % (31. Dezember 2021: 98,77 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
72.432	Simulations Plus Inc*	2.648.838	0,45
26.752	SiteOne Landscape Supply Inc*	3.138.545	0,53
109.215	Sitio Royalties Corp Class A*	3.150.853	0,53
731.505	Southwestern Energy Co*	4.279.304	0,72
79.211	SPS Commerce Inc*	10.173.069	1,72
9.858	SPX Technologies Inc*	647.178	0,11
76.310	Stock Yards Bancorp Inc*	4.958.624	0,84
86.641	TechTarget Inc*	3.817.402	0,64
56.006	Tetra Tech Inc*	8.131.511	1,37
2.178	Texas Pacific Land Corp*	5.105.733	0,86
67.670	Texas Roadhouse Inc Class A*	6.154.587	1,04
88.760	Toro Co*	10.047.632	1,70
22.816	Tractor Supply Co*	5.132.916	0,87
47.125	Transcat Inc*	3.339.749	0,56
16.052	Tyler Technologies Inc*	5.175.325	0,87
32.133	UFP Technologies Inc*	3.788.159	0,64
147.572	United Community Banks Inc*	4.987.934	0,84
131.443	Utz Brands Inc*	2.084.686	0,35
38.078	Valmont Industries Inc*	12.591.252	2,13
170.377	Vertex Inc Class A*	2.472.170	0,42
19.646	Watsco Inc*	4.899.712	0,83
32.759	WD-40 Co*	5.281.078	0,89
34.763	West Pharmaceutical Services Inc*	8.181.472	1,38
63.455	XPEL Inc*	3.811.107	0,64
12.301	Zebra Technologies Corp Class A*	3.154.099	0,53
<b>Aktien insgesamt</b>		<b>578.779.674</b>	<b>97,70</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>578.779.674</b>	<b>97,70</b>

### Devisenterminkontrakte 0,16 % (31. Dezember 2021: 0,02 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
477.858 AUD	305.029 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	19.225	0,00
237.962 AUD	156.448 US\$	18.01.2023	UBS AG	3	5.023	0,00
5.227.021 AUD	3.396.445 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	54	150.395	0,03
137.261 US\$	200.493 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	5	1.214	0,00
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
797.852 €	817.439 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	6	34.929	0,01
49.331 €	49.459 US\$	18.01.2023	UBS AG	1	3.243	0,00
8.455.000 €	8.455.267 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	39	577.461	0,10

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,16 % (31. Dezember 2021: 0,02 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
56.480 US\$	959.525 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	2	158	0,00
1 US\$	14 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
44.731.700 ZAR	2.493.183 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	14	132.448	0,02
3.181.791 ZAR	177.070 US\$	18.01.2023	UBS AG	6	9.693	0,00
6.298.928 ZAR	354.064 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	54	15.668	0,00
<b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>949.457</b>	<b>0,16</b>
					<b>Zeitwert % des Nettovermögens</b>	
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					<b>579.729.131</b>	<b>97,86</b>

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2021: (0,08 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
<i>Abgesicherte Klassen AUD</i>						
189.181 AUD	129.301 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(931)	(0,00)
129.888 AUD	88.587 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	6	(452)	(0,00)
494.705 US\$	752.867 AUD	18.01.2023	Goldman Sachs International	8	(16.159)	(0,00)
93.049 US\$	140.205 AUD	18.01.2023	UBS AG	2	(2.087)	(0,00)
573.228 US\$	879.513 AUD	18.01.2023	Westpac Banking Corp	40	(23.574)	(0,01)
<i>Abgesicherte Klassen EUR</i>						
131.938 €	141.455 US\$	18.01.2023	Goldman Sachs International	1	(502)	(0,00)
42.205 €	45.119 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	1	(30)	(0,00)
416.463 US\$	412.812 €	18.01.2023	Goldman Sachs International	4	(24.555)	(0,01)
156.422 US\$	148.525 €	18.01.2023	UBS AG	2	(2.252)	(0,00)
2.677.688 US\$	2.627.912 €	18.01.2023	Westpac Banking Corp	40	(129.792)	(0,02)
<i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>						
248.110 US\$	4.445.099 ZAR	18.01.2023	Goldman Sachs International	7	(12.805)	(0,00)
198.778 US\$	3.437.271 ZAR	18.01.2023	UBS AG	4	(2.980)	(0,00)
468.638 US\$	8.334.513 ZAR	18.01.2023	Westpac Banking Corp	42	(20.576)	(0,00)
15.442 ZAR	911 US\$	18.01.2023	Westpac Banking Corp	3	(4)	(0,00)
<b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>					<b>(236.699)</b>	<b>(0,04)</b>

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(236.699)</b>	<b>(0,04)</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>	<b>579.492.432</b>	<b>97,82</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>12.886.235</b>	<b>2,18</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>	<b>592.378.667</b>	<b>100,00</b>

<b>Portfolioanalyse</b>	US\$	% des Gesamtver- mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	575.669.160	96,88
** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	3.110.514	0,52
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	712.758	0,12
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>579.492.432</b>	<b>97,52</b>



## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Aktien	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 95,19 % (31. Dezember 2021: 91,93 %)</b>			
<b>US-Dollar</b>			
61.431	Acadia Healthcare Co Inc	5.057.000	2,61
280.567	Accuray Inc	586.385	0,30
183.288	Adeia Inc	1.737.570	0,90
62.989	AerCap Holdings NV	3.673.518	1,89
187.791	Amneal Pharmaceuticals Inc	373.704	0,19
17.360	Arcosa Inc	943.342	0,49
32.954	AtriCure Inc	1.462.498	0,75
44.052	Avanos Medical Inc	1.192.047	0,61
27.085	Avery Dennison Corp	4.902.385	2,53
358.379	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	2.067.847	1,07
85.101	BankUnited Inc	2.890.881	1,49
78.833	Bloom Energy Corp Class A	1.507.287	0,78
52.459	Box Inc Class A	1.633.049	0,84
17.574	Bread Financial Holdings Inc	661.837	0,34
52.593	Caleres Inc	1.171.772	0,60
42.086	Cardiovascular Systems Inc	573.211	0,29
40.191	CEVA Inc	1.028.086	0,53
10.605	Charles River Laboratories International Inc	2.310.830	1,19
151.805	Chico's FAS Inc	746.881	0,39
23.133	Children's Place Inc	842.504	0,43
100.920	Ciena Corp	5.144.901	2,65
21.152	Clean Harbors Inc	2.413.866	1,25
222.489	Cleveland-Cliffs Inc	3.584.298	1,85
100.137	CNX Resources Corp	1.686.307	0,87
270.250	Cognyte Software Ltd	840.477	0,43
21.076	Coherent Corp	739.768	0,38
42.203	Comerica Inc	2.821.270	1,45
673.014	Conduent Inc	2.725.707	1,41
200.208	Criteo SA ADR	5.217.421	2,69
56.953	Crown Holdings Inc	4.682.106	2,42
74.173	CytoSorbents Corp	114.968	0,06
77.687	Devon Energy Corp	4.778.528	2,46
114.241	Diebold Nixdorf Inc	162.222	0,08
42.057	Dril-Quip Inc	1.142.689	0,59
123.408	EMCORE Corp	118.780	0,06
54.317	Energpac Tool Group Corp Class A	1.382.368	0,71
5.040	Entegris Inc	330.574	0,17
39.898	Haemonetics Corp	3.137.978	1,62
54.358	Hain Celestial Group Inc	879.512	0,45

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 95,19 % (31. Dezember 2021: 91,93%) (Fortsetzung)</b>			
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>			
164.320	Harsco Corp	1.033.573	0,53
224.788	Huntington Bancshares Inc	3.169.511	1,63
152.902	Infinera Corp	1.030.560	0,53
163.135	Innoviz Technologies Ltd	641.121	0,33
210.350	International Game Technology Plc	4.770.738	2,46
11.018	ION Geophysical Corp	0	0,00
38.756	Itron Inc	1.962.991	1,01
174.825	KAR Auction Services Inc	2.281.466	1,18
121.206	KBR Inc	6.399.677	3,30
186.239	Kyndryl Holdings Inc	2.070.978	1,07
342.908	Lions Gate Entertainment Corp Class B	1.861.991	0,96
77.455	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	4.878.116	2,51
185.438	Markforged Holding Corp	215.108	0,11
22.956	Mercury Systems Inc	1.027.051	0,53
11.974	Molina Healthcare Inc	3.954.054	2,04
43.035	New Relic Inc	2.429.326	1,25
49.784	nLight Inc	504.810	0,26
37.787	ODP Corp	1.720.820	0,89
147.433	Oil States International Inc	1.099.850	0,57
86.775	OneSpan Inc	971.012	0,50
176.883	OraSure Technologies Inc	852.576	0,44
53.038	Ormat Technologies Inc	4.586.726	2,36
16.616	OSI Systems Inc	1.321.304	0,68
43.478	Patterson Cos Inc	1.218.688	0,63
44.921	Patterson-UTI Energy Inc	756.470	0,39
692.382	Quantum Corp	754.696	0,39
61.422	Radware Ltd	1.213.085	0,63
193.965	Rambus Inc	6.947.826	3,58
207.909	Resideo Technologies Inc	3.420.103	1,76
836.118	Ribbon Communications Inc	2.332.769	1,20
27.273	SeaWorld Entertainment Inc	1.459.378	0,75
26.774	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	792.511	0,41
236.113	Standard BioTools Inc	276.252	0,14
54.914	Stericycle Inc	2.739.660	1,41
171.240	Stratasys Ltd	2.030.907	1,05
180.016	TechnipFMC Plc	2.194.395	1,13
4.882	Teledyne Technologies Inc	1.952.361	1,00
72.785	Tempur Sealy International Inc	2.498.709	1,29
229.046	TETRA Technologies Inc	792.499	0,41
48.815	Texas Capital Bancshares Inc	2.944.033	1,52

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung			Zeitwert US\$	% des Netto- vermögens
<b>Aktien 95,19 % (31. Dezember 2021: 91,93%) (Fortsetzung)</b>					
<b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>					
55.935	TreeHouse Foods Inc			2.762.070	1,43
14.272	Twin Discount Inc			138.724	0,07
299.840	Unisys Corp			1.532.182	0,79
6.460	Valmont Industries Inc			2.136.128	1,10
52.944	Varex Imaging Corp			1.074.763	0,55
34.836	Varonis Systems Inc Class B			833.974	0,43
188.395	Veeco Instruments Inc			3.500.379	1,80
63.065	Verint Systems Inc			2.287.998	1,18
98.566	Viasat Inc			3.119.614	1,61
138.369	Viavi Solutions Inc			1.454.258	0,75
128.018	Vistra Corp			2.970.018	1,53
16.450	Wix.com Ltd			1.263.853	0,65
147.584	Xperi Inc			1.270.698	0,65
	<b>Aktien insgesamt *</b>			<b>184.718.734</b>	<b>95,19</b>
<b>Immobilienaktiengesellschaften 1,12 % (31. Dezember 2021: 0,86 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
65.316	Chatham Lodging Trust			801.427	0,41
63.530	RLJ Lodging Trust			672.783	0,35
72.094	Sunstone Hotel Investors Inc			696.428	0,36
	<b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>			<b>2.170.638</b>	<b>1,12</b>
<b>Kapital- betrag</b>	<b>Wertpapierbezeichnung</b>	<b>Kupon</b>	<b>Fälligkeits- datum</b>	<b>Zeitwert US\$</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
<b>Unternehmensanleihen 0,00 % (31. Dezember 2021: 0,02 %)</b>					
<b>US-Dollar</b>					
32.000	ION Geophysical Escrow Corp	8,00 %	15.12.2025	0	0,00
	<b>Unternehmensanleihen insgesamt *</b>			<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Anlagen insgesamt</b>			<b>186.889.372</b>	<b>96,31</b>
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>				<b>186.889.372</b>	<b>96,31</b>
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>				<b>186.889.372</b>	<b>96,31</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>				<b>7.151.668</b>	<b>3,69</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>				<b>194.041.040</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>				<b>US\$</b>	<b>% des Gesamtver- mögens</b>
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind				186.889.372	94,54
<b>Anlagen insgesamt</b>				<b>186.889.372</b>	<b>94,54</b>

## Bilanzen

		5G Connectivity	Absolute Return Multi Strategy	Asian Debt - Hard Currency	China A-Share Equity	China Bond	China Equity	CLO Income	Commodities
	Anm.	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022* US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 CNY	Zum 31. Dezember 2022 CNY	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	965.036.484	6.766	20.262.516	15.317.693	429.085.411	307.949.549	116.138.374	77.727.468
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	34.119.654	93.179	1.180.261	952.930	22.788.957	8.545.056	20.349.795	8.094.998
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.505.517	–	–	–	19.609.680	2.164.762	934	5.565.123
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		1.012.596	–	–	–	194	–	–	311.481
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	55.253	–	839.388	–	320.000	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		432.516	–	299.519	256.475	44.536.205	227	2.790.144	202.284
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>1.004.106.767</b>	<b>99.945</b>	<b>21.797.549</b>	<b>16.527.098</b>	<b>516.859.835</b>	<b>318.659.594</b>	<b>139.599.247</b>	<b>91.901.354</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	3.280.059	–	88.173	–	2.739.680	817.712	1.324.169	333.046
Kontenüberziehung	4	129	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		1.380.674	–	18.123	–	1.522.147	1.759	–	11.154
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	–	5.450.000
Antizipative Passiva		1.542.416	–	43.612	207.005	367.670	405.069	106.080	85.152
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		4.858.404	–	–	–	58.969.849	–	85.088	–
Sonstige Verbindlichkeiten		34.892	99.945	21.432	78.335	216.910	21.378	46.446	24.573
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>11.096.574</b>	<b>99.945</b>	<b>171.340</b>	<b>285.340</b>	<b>63.816.256</b>	<b>1.245.918</b>	<b>1.561.783</b>	<b>5.903.925</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>993.010.193</b>	<b>–</b>	<b>21.626.209</b>	<b>16.241.758</b>	<b>453.043.579</b>	<b>317.413.676</b>	<b>138.037.464</b>	<b>85.997.429</b>

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		Corporate Hybrid Bond	Emerging Market Debt - Hard Currency	Emerging Market Debt - Local Currency	Emerging Market Debt Blend	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Emerging Markets Equity	Emerging Markets Select Equity	Euro Bond Absolute Return
	Anm.	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022
		EUR	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	1.684.830.088	2.346.546.593	1.360.283.509	463.102.332	50.898.306	189.787.819	90.426.979	47.520.374
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	124.965.163	107.924.157	12.401.585	4.035.002	3.413.071	5.356.295	3.402.931	1.710.742
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	–	3.199.020	16.293.590	7.893	–	34.597	86.705
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		1.293.606	4.103.978	883.605	275.687	–	362.074	16.812	13.876.229
Forderungen gegenüber Brokern		–	3.276.177	54.984.796	9.999.389	424.677	–	–	252.313
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		33.042.330	59.709.417	30.010.757	11.304.641	746.361	550.079	193.164	435.363
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>1.844.131.187</b>	<b>2.521.560.322</b>	<b>1.461.763.272</b>	<b>505.010.641</b>	<b>55.490.308</b>	<b>196.056.267</b>	<b>94.074.483</b>	<b>63.881.726</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	57.668.909	11.868.883	57.448.294	13.780.086	542.408	666.859	–	1.279.616
Kontenüberziehung	4	–	–	–	–	12	345	–	388
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		1.782.089	14.282.774	1.482.933	621.342	1.033	2.563.061	577	13.827.198
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	3.980.000	840.000	–	–	–	–
Antizipative Passiva		1.193.107	2.024.113	1.301.053	469.534	63.835	289.525	124.746	51.536
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		1.276.923	1.572.454	2.187.526	1.940.067	499.247	38.266	40.672	46.881
Sonstige Verbindlichkeiten		55.351	107.170	9.099.023	17.178.132	109.392	690.456	146.366	148.231
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>61.976.379</b>	<b>29.855.394</b>	<b>75.498.829</b>	<b>34.829.161</b>	<b>1.215.927</b>	<b>4.248.512</b>	<b>312.361</b>	<b>15.353.850</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>1.782.154.808</b>	<b>2.491.704.928</b>	<b>1.386.264.443</b>	<b>470.181.480</b>	<b>54.274.381</b>	<b>191.807.755</b>	<b>93.762.122</b>	<b>48.527.876</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		Euro Opportunistic Bond	European High Yield Bond	European Sustainable Equity	Event Driven	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Megatrends	Global Flexible Credit Income
	Anm.	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022
		EUR	EUR	EUR	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	8.590.398	33.741.184	174.388.827	34.759.787	133.785.619	154.791.860	79.465.335	385.148.567
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	473.148	1.372.196	1.487.612	6.873.963	4.700.090	50.248.991	77.732	10.118.861
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		121.972	2	–	–	834.394	–	–	154.968
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	13.705.182	5.007.586	–	–	–	40.452	9.991
Forderungen gegenüber Brokern		258.450	–	–	–	376.572	–	–	5.284.784
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		102.378	544.743	172.097	8.601	867.942	1.581.894	115.036	6.555.070
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>9.546.346</b>	<b>49.363.307</b>	<b>181.056.122</b>	<b>41.642.351</b>	<b>140.564.617</b>	<b>206.622.745</b>	<b>79.698.555</b>	<b>407.272.241</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	112.447	3.113.019	–	18.616	2.112.792	417	–	12.005.976
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	13.707.154	3.727.664	–	–	46.050.000	134.741	28.122
Antizipative Passiva		34.664	50.457	134.129	76.524	65.484	167.100	188.716	280.150
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		17.717	20.048	1.319.645	–	3.505.750	–	37	352.483
Sonstige Verbindlichkeiten		86.776	18.101	20.454	100.539	69.295	9.142	30.696	79.181
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>251.604</b>	<b>16.908.779</b>	<b>5.201.892</b>	<b>195.679</b>	<b>5.753.321</b>	<b>46.226.659</b>	<b>354.190</b>	<b>12.745.912</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>9.294.742</b>	<b>32.454.528</b>	<b>175.854.230</b>	<b>41.446.672</b>	<b>134.811.296</b>	<b>160.396.086</b>	<b>79.344.365</b>	<b>394.526.329</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		Global High Yield SDG Engagement	Global High Yield Sustainable Action	Global Investment Grade Credit	Global Opportunistic Bond	Global Real Estate Securities	Global Sustainable Equity	High Yield Bond	InnovAsia 5G
	Anm.	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	286.905.751	14.547.172	83.541.497	80.110.952	38.072.868	130.524.482	2.170.021.483	14.325.847
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	5.259.514	1.033.221	3.565.231	5.863.263	1.125.241	1.070.714	134.476.435	596.336
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		71.005	253	–	406.959	13	–	4.627.097	41.445
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		123.184.909	–	–	14	–	4.411.790	3.517.926	–
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	–	1.228.672	–	–	300.000	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		5.725.188	279.956	882.351	908.005	119.762	91.089	38.784.027	69.903
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>421.146.367</b>	<b>15.860.602</b>	<b>87.989.079</b>	<b>88.517.865</b>	<b>39.317.884</b>	<b>136.098.075</b>	<b>2.351.726.968</b>	<b>15.033.531</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	9.426.254	358.029	1.642.819	5.529.567	147.763	–	25.597.669	78.732
Kontenüberziehung	4	15	–	–	–	86	–	149	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		144.749	–	–	30	69.724	4.397.123	5.887.375	32.016
Antizipative Passiva		120.597	40.994	90.568	75.034	58.301	116.088	2.442.382	103.033
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		74.390.132	406.264	–	6.676.859	–	7	18.780.475	48.481
Sonstige Verbindlichkeiten		111.242	8.247	347.050	130.932	19.590	6.658	267.206	22.276
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>84.192.989</b>	<b>813.534</b>	<b>2.080.437</b>	<b>12.412.422</b>	<b>295.464</b>	<b>4.519.876</b>	<b>52.975.256</b>	<b>284.538</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>336.953.378</b>	<b>15.047.068</b>	<b>85.908.642</b>	<b>76.105.443</b>	<b>39.022.420</b>	<b>131.578.199</b>	<b>2.298.751.712</b>	<b>14.748.993</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Multi-Asset Income	Next Generation Mobility	Next Generation Space Economy	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement	Strategic Income
	Anm.	Zum 31. Dezember 2022 JPY	Zum 31. Dezember 2022 EUR	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	20.251.986.644	35.753.350	9.231.268	138.694.644	7.981.674	4.901.636.040	536.260.884	1.454.526.951
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	421.921.338	131.107	1.795.321	9.717.383	555.274	196.555.616	27.853.758	104.978.500
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	67	284.261	72.621	–	11.003	56.462	34.551.202
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	66.778	67.840	279.664	19.545	9.283.967	2.421.432	5.263.162
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	628.167	–	–	–	–	3.722.665
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		28.870.308	107.020	189.122	53.143	13.778	77.069.801	7.908.182	13.288.492
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>20.702.778.290</b>	<b>36.058.322</b>	<b>12.195.979</b>	<b>148.817.455</b>	<b>8.570.271</b>	<b>5.184.556.427</b>	<b>574.500.718</b>	<b>1.616.330.972</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	141.215.249	4.428.576	647.046	213.661	–	25.830.013	5.286.451	13.465.056
Kontenüberziehung	4	98.494	–	3.963	–	–	–	–	155
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	51.700	–	79.879	–	7.657.731	3.628.199	3.707.806
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	–	250.000
Antizipative Passiva		12.310.780	48.457	74.442	279.259	42.290	3.062.519	411.720	1.089.994
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		5.076.179	–	67.370	216.677	23.001	23.342.727	8.756.374	274.300.844
Sonstige Verbindlichkeiten		1.410.003	19.433	37.043	23.302	14.118	1.687	44.295	711.262
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>160.110.705</b>	<b>4.548.166</b>	<b>829.864</b>	<b>812.778</b>	<b>79.409</b>	<b>59.894.677</b>	<b>18.127.039</b>	<b>293.525.117</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>20.542.667.585</b>	<b>31.510.156</b>	<b>11.366.115</b>	<b>148.004.677</b>	<b>8.490.862</b>	<b>5.124.661.750</b>	<b>556.373.679</b>	<b>1.322.805.855</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.



## Bilanzen (Fortsetzung)

		Sustainable Asia High Yield	Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	Systematic Global Sustainable Value	Ultra Short Term Euro Bond	Uncorrelated Strategies	XXXXXXXXXXXX	US Equity
	Anm.	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022
		US\$	US\$	US\$	US\$	EUR	US\$	US\$	US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	28.628.399	92.287.239	147.618.248	47.841.138	808.942.173	2.555.941.719	598.691.431	29.642.109
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	2.770.190	6.953.109	8.625.196	727.506	10.039.473	301.147.318	66.208.500	2.395.266
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	–	6.851	270.540	7.615	84.079.197	25.143.028	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	198.096	2.755.712	3.427	606.680	10.881.609	303.985	7.971
Forderungen gegenüber Brokern		58.035	166.695	199.602	–	6.612.268	737.006.142	89.712.105	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		679.979	1.542.219	3.029.425	113.386	7.293.900	228.604.888	19.269.949	25.906
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>32.136.603</b>	<b>101.147.358</b>	<b>162.235.034</b>	<b>48.955.997</b>	<b>833.502.109</b>	<b>3.917.660.873</b>	<b>799.328.998</b>	<b>32.071.252</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	29.229	141.962	908.488	90.456	10.569.827	489.983.868	59.324.225	546.931
Kontenüberziehung	4	–	1.508.656	–	–	–	22.735	27.694	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	177.478	2.726.126	727.660	322.425	2.890.689	223.254	–
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	5.000	63.659	–
Antizipative Passiva		70.771	149.274	117.559	55.463	257.172	2.108.050	1.477.266	47.361
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		85.047	809.961	–	152	608.123	126.044.433	14.876.428	–
Sonstige Verbindlichkeiten		29.285	115.719	62.267	57.825	354.495	166.119.116	11.393.762	12.131
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>214.332</b>	<b>2.903.050</b>	<b>3.814.440</b>	<b>931.556</b>	<b>12.112.042</b>	<b>787.173.891</b>	<b>87.386.288</b>	<b>606.423</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>31.922.271</b>	<b>98.244.308</b>	<b>158.420.594</b>	<b>48.024.441</b>	<b>821.390.067</b>	<b>3.130.486.982</b>	<b>711.942.710</b>	<b>31.464.829</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		US Equity Index PutWrite	US Large Cap Value	US Long Short Equity	US Multi Cap Opportunities	US Real Estate Securities	US Small Cap	US Small Cap Intrinsic Value	Fonds insgesamt*
	Anm.	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	648.856.403	1.689.599.584	179.143.690	441.762.007	628.621.129	579.729.131	186.889.372	27.511.074.629
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	44.491.927	75.198.123	34.444.171	1.259.174	21.884.190	10.674.691	8.840.096	1.518.644.441
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.987.199	17.011.441	8.813.281	2.155.112	96	109.183	1.398.733	217.909.539
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		567.528	5.505.395	289.671	823.707	3.580.698	1.178.559	491.844	217.511.029
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	11.644.215	–	–	–	–	927.110.748
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		379.288	1.854.555	891.436	219.477	1.956.405	2.524.308	66.145	573.072.046
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>698.282.345</b>	<b>1.789.169.098</b>	<b>235.226.464</b>	<b>446.219.477</b>	<b>656.042.518</b>	<b>594.215.872</b>	<b>197.686.190</b>	<b>30.965.322.432</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	14.283.196	102.612	2.889.863	587.402	1.230.032	236.699	–	846.692.109
Kontenüberziehung	4	–	–	–	–	–	–	–	1.565.099
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		543.568	494.764	1.227.732	1.019.084	3.412.368	780.783	287.203	142.576.198
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	–	10.588.659
Antizipative Passiva		366.712	1.065.730	329.297	631.626	1.318.524	654.722	196.002	25.893.180
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		2.608.050	19.542.707	91.888	2.618.414	1.982.404	129.484	2.170.492	605.080.476
Sonstige Verbindlichkeiten		24.081	8.926	9.157.783	47.001	73.395	35.517	991.453	218.544.490
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>17.825.607</b>	<b>21.214.739</b>	<b>13.696.563</b>	<b>4.903.527</b>	<b>8.016.723</b>	<b>1.837.205</b>	<b>3.645.150</b>	<b>1.850.940.211</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>680.456.738</b>	<b>1.767.954.359</b>	<b>221.529.901</b>	<b>441.315.950</b>	<b>648.025.795</b>	<b>592.378.667</b>	<b>194.041.040</b>	<b>29.114.382.221</b>

Direktor:  
Tom Finlay

Direktor:  
Naomi Daly

Datum: 19. April 2023

Datum: 19. April 2023

\* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		5G Connectivity	Absolute Return Multi Strategy	Asian Debt - Hard Currency	China A-Share Equity	China Bond	China Equity	CLO Income	Corporate Hybrid Bond
	Anm.	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021* US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 CNY	Zum 31. Dezember 2021 CNY	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 EUR
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	2.329.245.848	31.388	14.092.186	23.719.184	546.051.313	503.564.287	133.428.005	2.275.532.572
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	92.735.290	79.477	151.741	764.101	29.971.297	27.783.767	24.669.895	171.915.142
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		24.177.668	12.507	1.824	–	–	–	4.034	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		4.453.014	–	–	–	51.568	–	–	4.950.857
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	104.923	–	1.045.401	–	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		956.447	100.246	192.527	203.752	12.104.737	116.590	1.605.809	36.430.645
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>2.451.568.267</b>	<b>223.618</b>	<b>14.543.201</b>	<b>24.687.037</b>	<b>589.224.316</b>	<b>531.464.644</b>	<b>159.707.743</b>	<b>2.488.829.216</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	5.949.073	11.507	36.123	–	3.203.304	268.158	698.215	15.718.355
Kontenüberziehung	4	–	353	–	–	–	–	945	81.862
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		12.814.783	–	29.510	–	4.542.833	178.282	898.022	13.055.646
Antizipative Passiva		3.054.124	150.687	32.750	241.737	659.144	692.960	117.325	1.537.373
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		34.117.457	–	–	–	5.158	962.105	8.101.570	804
Sonstige Verbindlichkeiten		111.189	61.071	15.298	17.342	60.219	21.948	52.234	23.201
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>56.046.626</b>	<b>223.618</b>	<b>113.681</b>	<b>259.079</b>	<b>8.470.658</b>	<b>2.123.453</b>	<b>9.868.311</b>	<b>30.417.241</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>2.395.521.641</b>	<b>–</b>	<b>14.429.520</b>	<b>24.427.958</b>	<b>580.753.658</b>	<b>529.341.191</b>	<b>149.839.432</b>	<b>2.458.411.975</b>

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

Anm.	Diversified	Emerging Market	Emerging Market	Emerging Market	Emerging Market	Emerging Market	Emerging Markets	Emerging Markets
	Currency	Debt - Hard	Debt - Local	Debt Blend	Investment Grade	Debt Sustainable	Equity	Select Equity
	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum
	31. Dezember	31. Dezember	31. Dezember	31. Dezember	31. Dezember	31. Dezember	31. Dezember	31. Dezember
	2021*	2021	2021	2021	2021	2021	2021	2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Umlaufvermögen</b>								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	–	3.444.899.794	1.964.315.165	897.575.533	44.243.874	378.437.643	123.167.159
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	19.616	102.927.978	125.681.417	42.675.944	2.840.473	12.358.826	2.015.621
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	1.046	12.645.721	12.685	21	1.093.900	158.355
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	19.087.151	2.201.460	573.063	–	512.359	114.256
Forderungen gegenüber Brokern		–	2.618.513	53.928.225	12.466.134	270.656	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		2.180	59.029.653	38.512.196	16.339.259	471.547	934.178	293.874
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		21.796	3.628.564.135	2.197.284.184	969.642.618	47.826.571	393.336.906	125.749.265
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	–	2.612.993	62.804.508	15.676.230	277.401	688.813	–
Kontenüberziehung	4	233	32.786	–	1.259	128	168	183
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	10.423.350	2.334.399	1.599.477	68.661	309.830	–
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	5.460.000	1.040.000	–	–	–
Antizipative Passiva		17.744	2.640.827	1.730.477	710.064	50.352	539.416	137.121
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	10.997	14.020.068	854.038	5.086	1.150.495	141.796
Sonstige Verbindlichkeiten		3.819	267.692	8.252.080	2.180.106	38.664	1.957.759	113.896
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		21.796	15.988.645	94.601.532	22.061.174	440.292	4.646.481	392.996
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		–	3.612.575.490	2.102.682.652	947.581.444	47.386.279	388.690.425	125.356.269

\* Der Diversified Currency wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		Euro Bond Absolute Return	Euro Opportunistic Bond	European High Yield Bond	European Sustainable Equity	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Index PutWrite	Global Equity Megatrends
	Anm.	Zum 31. Dezember 2021 EUR	Zum 31. Dezember 2021 EUR	Zum 31. Dezember 2021 EUR	Zum 31. Dezember 2021 EUR	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021* US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	49.488.115	10.495.879	37.770.673	110.416.942	174.620.194	217.956.994	–	81.955.406
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	2.388.212	520.124	950.762	627.445	10.799.983	13.562.145	36.966	747.836
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		58.720	10.372	–	69.114	410.235	–	–	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		1.916.167	–	20.585	20.053.240	–	–	–	582.199
Forderungen gegenüber Brokern		1.030.197	252.711	–	–	386.761	–	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		222.839	94.915	542.175	76.902	740.492	2.528.689	119.121	96.353
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>55.104.250</b>	<b>11.374.001</b>	<b>39.284.195</b>	<b>131.243.643</b>	<b>186.957.665</b>	<b>234.047.828</b>	<b>156.087</b>	<b>83.381.794</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	518.843	109.617	320.550	–	1.195.889	76.865	–	–
Kontenüberziehung	4	1.916	261	451	359	1.872	–	25.102	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		332.628	–	51.358	–	–	45.000	–	30.692
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	–	–
Antizipative Passiva		45.227	31.124	42.273	85.730	35.468	174.314	83.848	166.171
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		22.667	6.172	91	17.243.083	5.301.539	–	–	99
Sonstige Verbindlichkeiten		18.124	15.491	4.161	28.396	25.519	4.240	47.137	30.983
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>939.405</b>	<b>162.665</b>	<b>418.884</b>	<b>17.357.568</b>	<b>6.560.287</b>	<b>300.419</b>	<b>156.087</b>	<b>227.945</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>54.164.845</b>	<b>11.211.336</b>	<b>38.865.311</b>	<b>113.886.075</b>	<b>180.397.378</b>	<b>233.747.409</b>	<b>–</b>	<b>83.153.849</b>

\* Der Global Equity Index PutWrite wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

Anm.	Global Flexible	Global High Yield	Global High Yield	Global Investment	Global	Global Real Estate	Global Sustainable	High Yield Bond	
	Credit Income	SDG Engagement	Sustainable Action	Grade Credit	Opportunistic Bond	Securities	Equity		
	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$		
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	615.038.096	39.452.243	16.892.910	96.909.294	96.842.534	50.669.393	202.536.546	3.045.487.902
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	80.947.344	640.813	660.970	1.208.142	1.383.723	511.057	1.034.608	172.469.054
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		713	–	141	–	2.593	–	10.156.887	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		970.172	30.787	–	–	4.000	301.799	1.842.233	10.129.466
Forderungen gegenüber Brokern		4.551.058	–	–	–	3.032.318	–	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		9.757.200	647.537	287.681	766.499	819.543	94.580	135.964	44.054.765
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>711.264.583</b>	<b>40.771.380</b>	<b>17.841.702</b>	<b>98.883.935</b>	<b>102.084.711</b>	<b>51.576.829</b>	<b>215.706.238</b>	<b>3.272.141.187</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	5.478.670	951.937	10.258	9.663	2.845.880	201.281	–	25.945.509
Kontenüberziehung	4	4.458	79	92	84	637	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	31.024	–	–	–	174.021	11.500.000	6.354.101
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		250.000	–	–	–	–	–	–	430.000
Antizipative Passiva		314.106	45.612	35.438	38.319	65.958	58.616	163.628	3.126.417
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		199	97.707	193.286	–	4.892.983	254.855	16.452	32.669.581
Sonstige Verbindlichkeiten		4.366	17.672	2.075	25.667	34.422	485	39.578	260.106
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>6.051.799</b>	<b>1.144.031</b>	<b>241.149</b>	<b>73.733</b>	<b>7.839.880</b>	<b>689.258</b>	<b>11.719.658</b>	<b>68.785.714</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>705.212.784</b>	<b>39.627.349</b>	<b>17.600.553</b>	<b>98.810.202</b>	<b>94.244.831</b>	<b>50.887.571</b>	<b>203.986.580</b>	<b>3.203.355.473</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

		InnovAsia 5G	Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Multi-Asset Income	Multi-Style Premia	Next Generation Mobility	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement
	Anm.	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 JPY	Zum 31. Dezember 2021 EUR	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021* US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	25.886.054	13.395.967.271	47.163.801	19.449.960	–	203.574.639	6.653.876.397	611.421.622
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	1.173.868	57.529.787	204.588	2.651.672	45.768	17.392.033	219.363.403	31.228.925
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		261.728	252.759.088	–	93.521	11	–	–	1.717.784
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		51.144	304.959.647	98.368	100.000	–	1.384.087	17.009.882	4.131.596
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	–	497.475	–	–	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		34.756	18.645.272	360.374	224.300	7	75.160	82.897.522	8.704.941
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>27.407.550</b>	<b>14.029.861.065</b>	<b>47.827.131</b>	<b>23.016.928</b>	<b>45.786</b>	<b>222.425.919</b>	<b>6.973.147.204</b>	<b>657.204.868</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	150.621	225.405	2.717.109	119.452	–	107.390	17.737.158	5.381.257
Kontenüberziehung	4	–	98.926	234	86	–	–	23.698	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	1.869.803.267	440.652	28.515	–	474.382	16.917.013	589.552
Antizipative Passiva		50.006	12.301.231	48.762	65.267	31.039	347.042	3.801.377	468.177
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		387.311	39.574.440	1.320	80.474	11	1.010.464	78.500	6.292.288
Sonstige Verbindlichkeiten		24.625	1.920.152	9.163	17.783	14.736	3.325	135.363	33.684
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>612.563</b>	<b>1.923.923.421</b>	<b>3.217.240</b>	<b>311.577</b>	<b>45.786</b>	<b>1.942.603</b>	<b>38.693.109</b>	<b>12.764.958</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>26.794.987</b>	<b>12.105.937.644</b>	<b>44.609.891</b>	<b>22.705.351</b>	<b>–</b>	<b>220.483.316</b>	<b>6.934.454.095</b>	<b>644.439.910</b>

\* Der Multi-Style Premia wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

Anm.	Strategic Income	Sustainable Asia High Yield	Sustaible Emerging Market Corporate Debt	Systematic Global Sustainable Value	Ultra Short Term Euro Bond	Uncorrelated Strategies	US Equity	US Equity Index PutWrite	
	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	
	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR	US\$	US\$	US\$	
<b>Umlaufvermögen</b>									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	1.571.681.775	22.216.171	141.431.693	20.830.344	1.042.687.995	1.461.899.223	8.378.190	393.164.767
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	149.491.358	2.325.513	1.061.738	21.093	109.410.277	1.073.013.116	559.929	82.924.686
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.582.150	–	–	–	446.049	23.362.147	49.392	330.815
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		4.484.298	–	863.824	85.364	4.185.856	10.124.497	30.064	2.519.289
Forderungen gegenüber Brokern		4.768.320	25.422	188.296	–	4.696.004	610.002.054	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		10.647.945	396.869	1.865.266	37.162	5.985.357	33.585.158	29.900	718.460
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>1.742.655.846</b>	<b>24.963.975</b>	<b>145.410.817</b>	<b>20.973.963</b>	<b>1.167.411.538</b>	<b>3.211.986.195</b>	<b>9.047.475</b>	<b>479.658.017</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	9.947.268	–	45.258	40.232	4.155.675	564.874.988	–	3.825.540
Kontenüberziehung	4	130	–	381	–	48.643	6.141	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		1.666.720	–	98.675	2.396	131.953	2.476.728	58.533	501.328
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		600.000	–	–	–	–	690.000	–	–
Antizipative Passiva		1.125.733	61.465	182.327	22.535	219.638	1.738.508	34.341	232.433
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		284.312.837	180.882	1.146	4	1.447.583	54.709.909	18.545	15.997
Sonstige Verbindlichkeiten		81.635	351	25.605	20.546	737.508	9.130.709	4.451	5.584
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>297.734.323</b>	<b>242.698</b>	<b>353.392</b>	<b>85.713</b>	<b>6.741.000</b>	<b>633.626.983</b>	<b>115.870</b>	<b>4.580.882</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>1.444.921.523</b>	<b>24.721.277</b>	<b>145.057.425</b>	<b>20.888.250</b>	<b>1.160.670.538</b>	<b>2.578.359.212</b>	<b>8.931.605</b>	<b>475.077.135</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.



## Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	US Large Cap Value Zum 31.Dezember 2021 US\$	US Long Short Equity Zum 31.Dezember 2021 US\$	US Multi Cap Opportunities Zum 31. Dezember 2021 US\$	US Real Estate Securities Zum 31. Dezember 2021 US\$	US Small Cap Zum 31. Dezember 2021 US\$	US Small Cap Intrinsic Value Zum 31. Dezember 2021 US\$	Fonds insgesamt* Zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Umlaufvermögen</b>								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	2.044.028	420.191.901	782.190.079	1.015.365.050	812.203.055	142.582.308	32.842.150.870
Barmittel und Barmitteläquivalente	3	59.203	46.501.757	6.485.790	880	12.251.033	10.093.059	2.705.167.601
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		11.512	2.529.557	2.677.390	5.019.558	597.973	–	89.771.229
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	1.323.903	3.570.736	26.664.090	2.990.391	1.274.036	155.574.656
Forderungen gegenüber Brokern		–	25.837.918	–	–	–	–	725.641.319
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		18.999	1.369.314	270.823	1.952.562	392.549	41.924	373.670.364
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>		<b>2.133.742</b>	<b>497.754.350</b>	<b>795.194.818</b>	<b>1.049.002.140</b>	<b>828.435.001</b>	<b>153.991.327</b>	<b>36.891.976.039</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	–	21.139.570	1.041.858	3.778.536	653.133	–	781.855.656
Kontenüberziehung	4	–	–	–	2.893.675	–	–	3.145.422
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	744.286	7.096.728	18.535.746	2.473.572	218.212	131.558.313
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	8.470.000
Antizipative Passiva		50.197	544.877	916.647	1.448.842	961.264	148.531	28.946.440
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		36.211	803.100	4.871.129	–	2.193.135	347	479.417.414
Sonstige Verbindlichkeiten		1.634	501.741	42.785	48.373	11.702	1.811	24.654.043
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>		<b>88.042</b>	<b>23.733.574</b>	<b>13.969.147</b>	<b>26.705.172</b>	<b>6.292.806</b>	<b>368.901</b>	<b>1.458.047.288</b>
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>		<b>2.045.700</b>	<b>474.020.776</b>	<b>781.225.671</b>	<b>1.022.296.968</b>	<b>822.142.195</b>	<b>153.622.426</b>	<b>35.433.928.751</b>

\* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen

		5G Connectivity	Absolute Return Multi Strategy	Asian Debt - Hard Currency	China A-Share Equity	China Bond	China Equity	CLO Income	Commodities Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022**
	Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022** US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	508.120	5.657	606.076	5	17.550.832	30.119	11.114.425	761.052
Dividendenerträge	1	7.178.948	4.375	–	292.013	–	10.269.050	–	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge		–	11.709	–	–	181.398	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(941.839.697)	(20.585)	(1.891.100)	(5.711.132)	(22.887.822)	(118.823.844)	(27.050.224)	(2.014.541)
		(934.152.629)	1.156	(1.285.024)	(5.419.114)	(5.155.592)	(108.524.675)	(15.935.799)	(1.253.489)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	19.318.527	–	98.138	178.248	933.339	4.936.192	754.722	215.308
Vertriebsgebühren	6	712.648	–	5.192	–	–	245.552	–	1.855
Verwaltungsgebühren	6	886.958	–	63.440	184.996	507.602	212.517	90.685	56.244
Bereitstellungsprovision	19	31.352	–	1.809	2.947	147.157	57.652	18.464	1.214
Depotgebühren	6	178.402	–	11.978	60.522	348.069	96.429	11.978	10.714
Gebühren der Verwahrstelle	6	69.708	–	715	990	26.990	19.916	6.763	1.977
Honorare	9	231.415	–	55.583	410.382	425.712	85.740	34.913	78.404
Honorare der Direktoren	7	4.413	–	4.413	26.679	25.027	6.008	4.413	4.511
Transaktionskosten	9	4.063.843	–	7.709	78.836	383.773	614.068	9.785	5.685
Gründungsaufwendungen	9	–	–	–	–	–	–	852	33.630
Prüfungshonorare	8	5.197	–	7.945	50.136	–	4.500	6.049	9.775
Umsatzsteuerentlastung		(9.178)	(6)	(55)	(130)	(2.854)	(2.644)	(860)	(337)
Sonstige Aufwendungen	9	38.111	315	10.209	59.626	43.742	19.417	5	4.607
Kostenverzicht	6	–	–	(137.097)	(837.096)	(411.916)	–	–	(68.886)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		25.531.396	309	129.979	216.136	2.426.641	6.295.347	937.769	354.701
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		6.766	27	179	–	92	–	77	3.364
Gezahlte Ausschüttungen	1	–	–	348.676	–	1.637.507	3.567	7.260.183	–
		6.766	27	348.855	–	1.637.599	3.567	7.260.260	3.364
Quellensteuern	1	1.353.511	820	–	28.972	1.191	644.858	–	–
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(961.044.302)	–	(1.763.858)	(5.664.222)	(9.221.023)	(115.468.447)	(24.133.828)	(1.611.554)

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Corporate Hybrid Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Emerging Markets Select Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	79.295.541	161.758.842	94.893.060	38.711.817	1.731.498	113.992	44.263	1.478.485
Dividendenerträge	1	–	–	–	–	–	6.665.213	1.781.971	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	58.183	4.832	–	225	–	3.729	7.254	1.599
Sonstige Erträge		–	1.169	1.378.016	223.635	5.772	–	–	774
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(361.963.166)	(907.566.216)	(362.048.632)	(194.294.151)	(10.289.442)	(104.550.163)	(31.139.498)	(2.689.235)
		(282.609.442)	(745.801.373)	(265.777.556)	(155.358.474)	(8.552.172)	(97.767.229)	(29.306.010)	(1.208.377)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	13.032.178	20.247.383	11.488.267	4.507.415	213.980	3.549.106	848.534	129.504
Vertriebsgebühren	6	234.871	283.501	488.229	28.973	–	633.038	–	–
Verwaltungsgebühren	6	938.540	1.498.184	993.867	507.693	94.007	269.047	65.031	75.304
Bereitstellungsprovision	19	280.396	404.319	234.390	88.155	5.838	37.131	13.636	7.513
Depotgebühren	6	146.044	182.518	994.955	215.807	11.978	158.696	57.652	11.642
Gebühren der Verwahrstelle	6	100.979	132.993	81.447	32.932	2.138	14.844	4.995	2.696
Honorare	9	177.179	264.145	214.230	115.727	49.205	157.724	74.598	45.713
Honorare der Direktoren	7	4.290	6.008	5.708	4.408	6.013	6.008	6.013	4.289
Transaktionskosten	9	92.938	283.413	821.821	321.071	67.397	821.150	220.689	30.251
Prüfungshonorare	8	5.637	–	–	5.551	10.090	1.352	7.475	4.796
Umsatzsteuerentlastung		(9.907)	(12.788)	(7.942)	(3.297)	(250)	(1.488)	(470)	(260)
Sonstige Aufwendungen	9	7.354	21.140	7.379	12.886	28.191	25.030	12.433	17.286
Kostenverzicht	6	–	–	(73.477)	–	(179.530)	–	–	(75.384)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		15.010.499	23.310.816	15.248.874	5.837.321	309.057	5.671.638	1.310.586	253.350
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		90	5.356	21.844	14.000	147	1.954	235	933
Gezahlte Ausschüttungen	1	14.808.934	40.376.295	27.734.955	6.413.111	–	2.683	391	273.051
		14.809.024	40.381.651	27.756.799	6.427.111	147	4.637	626	273.984
Quellensteuern	1	–	194	2.910.677	619.394	35.333	741.654	254.565	339
Kapitalertragsteuer	1	–	–	(1.700.716)	(253.248)	(892)	288.157	59.418	–
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(312.428.965)	(809.494.034)	(309.993.190)	(167.989.052)	(8.895.817)	(104.473.315)	(30.931.205)	(1.736.050)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		Euro Opportunistic Bond	European High Yield Bond	European Sustainable Equity	Event Driven Berichtszeitraum	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Megatrends	Global Flexible Credit Income
	Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	zum 31. Dezember 2022* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	291.490	1.579.480	285	46.006	3.672.397	9.413.111	6.923	31.152.028
Dividendenerträge	1	–	–	2.232.834	–	–	–	871.691	27.852
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	977	–	–	1	–	–	–
Sonstige Erträge		15.109	–	–	–	64	–	41.273	575.391
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(1.973.354)	(2.325.679)	(34.675.503)	1.508.010	(29.797.838)	(18.259.895)	(11.756.473)	(153.936.569)
		(1.666.755)	(745.222)	(32.442.384)	1.554.016	(26.125.376)	(8.846.784)	(10.836.586)	(122.181.298)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	35.202	123.290	703.244	45.155	10.726	1.127.870	1.156.284	2.181.890
Vertriebsgebühren	6	–	2.676	246	–	6.835	–	231.163	52.452
Verwaltungsgebühren	6	47.375	98.701	92.580	6.126	158.041	119.720	146.949	296.237
Bereitstellungsprovision	19	1.393	4.866	18.552	–	19.323	29.244	10.953	81.408
Depotgebühren	6	11.642	12.142	16.501	1.088	11.978	12.000	11.978	19.553
Gebühren der Verwahrstelle	6	503	1.766	7.448	180	7.385	10.580	3.997	27.943
Honorare	9	42.648	54.516	51.880	10.026	65.013	68.920	13.585	66.596
Honorare der Direktoren	7	4.290	4.290	4.290	756	6.008	4.413	6.013	5.108
Erfolgsabhängige Gebühr	6	–	–	–	89.185	–	–	–	–
Transaktionskosten	9	12.629	20.917	272.168	1.300	60.787	5.996	52.011	54.664
Gründungs aufwendungen	9	–	–	–	41.146	–	–	–	–
Prüfungshonorare	8	5.419	4.766	4.102	9.261	6.103	5.474	5.975	5.755
Umsatzsteuerentlastung		(48)	(164)	(833)	–	(717)	(1.304)	(471)	(3.680)
Sonstige Aufwendungen	9	7.283	7.237	14.409	1.019	6.134	7.137	16.621	8.902
Kostenverzicht	6	(97.305)	(133.519)	(2.297)	(18.805)	(15.740)	–	–	–
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	–	–	–	–	(3.232)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		71.031	201.484	1.182.290	186.437	341.876	1.390.050	1.655.058	2.793.596
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		186	–	1.299	4	1.712	–	357	9.004
Gezahlte Ausschüttungen	1	228.600	42.280	102.238	–	2.670	6.122.730	–	17.376
		228.786	42.280	103.537	4	4.382	6.122.730	357	26.380
Quellensteuern	1	22	–	259.294	–	11.787	–	132.826	404.810
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(1.966.594)	(988.986)	(33.987.505)	1.367.575	(26.483.421)	(16.359.564)	(12.624.827)	(125.406.084)

\* Der Event Driven wurde am 26. Oktober 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

Anm.	Global High Yield SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Global High Yield Sustainable Action Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Global Investment Grade Credit Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Global Opportunistic Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Global Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Global Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	InnovAsia 5G Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	9.427.806	795.609	2.806.792	2.954.283	9.224	24.531	148.199.441	9.677
Dividendenerträge	1	–	–	–	146.100	1.602.477	1.528.140	1.708.574	298.196
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	64	–	–	142	–	–	369.752	–
Sonstige Erträge		146.217	–	–	6	–	–	1.121.365	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(28.263.433)	(2.685.869)	(16.760.362)	(13.983.992)	(16.363.551)	(68.012.895)	(500.609.800)	(11.968.585)
		(18.689.346)	(1.890.260)	(13.953.570)	(10.883.461)	(14.751.850)	(66.460.224)	(349.210.668)	(11.660.712)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	538.649	81.903	45.058	169.512	321.261	776.253	22.808.364	190.730
Vertriebsgebühren	6	9.621	–	–	2.561	24.343	63.178	2.403.333	261
Verwaltungsgebühren	6	170.523	66.803	75.396	153.587	78.512	112.556	1.707.662	58.185
Bereitstellungsprovision	19	17.656	2.185	1.339	12.291	7.270	28.977	368.659	3.217
Depotgebühren	6	11.978	12.000	14.000	11.978	12.000	12.000	32.781	12.993
Gebühren der Verwahrstelle	6	8.288	782	2.734	4.127	2.329	9.493	124.075	506
Honorare	9	77.026	36.984	68.532	51.748	63.979	54.659	281.572	105.017
Honorare der Direktoren	7	4.608	4.408	4.230	4.608	4.408	4.408	4.413	5.344
Transaktionskosten	9	58.010	4.102	1.543	70.999	127.175	126.209	280.642	203.216
Prüfungshonorare	8	6.692	6.414	15.088	8.086	7.164	6.110	688	13.494
Umsatzsteuerentlastung		(355)	(66)	(542)	(407)	(245)	(1.256)	(15.511)	(131)
Sonstige Aufwendungen	9	9.459	7.671	4.816	28.964	10.704	614	10.586	7.975
Kostenverzicht	6	(170.483)	(108.883)	(73.986)	(136.859)	(89.942)	–	–	(243.487)
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	(1.023)	–	–	(200.972)	–
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		741.672	114.303	158.208	380.172	568.958	1.193.201	27.806.292	357.320
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		5	–	106	1.878	295	496	13.752	47
Gezahlte Ausschüttungen	1	199.127	548.922	–	242.312	250.739	–	89.100.366	–
		199.132	548.922	106	244.190	251.034	496	89.114.118	47
Quellensteuern	1	–	–	2.143	6.303	335.421	377.588	193.502	47.134
Kapitalertragsteuer	1	–	–	–	–	–	–	–	4.532
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(19.630.150)	(2.553.485)	(14.114.027)	(11.514.126)	(15.907.263)	(68.031.509)	(466.324.580)	(12.069.745)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Multi-Asset Income	Next Generation Mobility	Next Generation Space Economy Berichtszeitraum	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield ESG Engagement	Strategic Income
	Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 JPY	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	zum 31. Dezember 2022* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	–	320.985	405.092	132.714	6.059	243.380.880	32.092.463	49.594.262
Dividenerträge	1	414.616.230	–	311.350	1.633.835	67.962	–	124.934	60.777
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	–	–	–	–	11.742	19.067	21.952
Sonstige Erträge		–	–	2.621	–	–	–	36.380	179.045
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(1.741.078.724)	(1.971.787)	(3.111.883)	(57.817.347)	(432.375)	(1.101.068.370)	(89.765.536)	(245.259.988)
		(1.326.462.494)	(1.650.802)	(2.392.820)	(56.050.798)	(358.354)	(857.675.748)	(57.492.692)	(195.403.952)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	100.811.266	168.525	191.307	2.355.835	38.201	31.402.765	3.565.600	8.737.824
Vertriebsgebühren	6	–	137	43.482	372.424	5.251	843.022	79.027	1.030.707
Verwaltungsgebühren	6	10.583.025	66.743	130.760	174.933	18.121	2.510.377	346.178	1.038.690
Bereitstellungsprovision	19	1.161.813	5.229	2.735	24.197	116	823.258	78.800	186.188
Depotgebühren	6	2.339.804	11.661	11.978	12.000	8.033	419.115	13.978	38.581
Gebühren der Verwahrstelle	6	927.073	1.776	933	8.609	109	283.218	27.328	67.232
Honorare	9	5.788.301	44.584	58.885	59.724	44.930	385.610	96.916	157.565
Honorare der Direktoren	7	645.304	4.290	4.408	6.008	3.292	4.408	6.008	5.708
Transaktionskosten	9	25.289.140	47.420	72.084	71.537	16.665	142.903	67.382	278.648
Gründungsaufwendungen	9	–	–	–	–	33.380	–	–	–
Prüfungshonorare	8	564.361	6.418	5.536	8.876	9.810	1.852	–	12.275
Umsatzsteuerentlastung		(109.192)	(221)	(95)	(808)	–	(27.820)	(2.514)	(6.168)
Sonstige Aufwendungen	9	1.448.080	10.186	6.942	19.744	408	2.844	14.088	428
Kostenverzicht	6	–	(110.430)	(244.304)	–	(91.761)	–	–	–
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	–	–	–	(14.829)	(7.051)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		149.448.975	256.318	284.651	3.113.079	86.555	36.791.552	4.277.962	11.540.627
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		2.090.931	386	413	–	–	54.957	–	238
Gezahlte Ausschüttungen	1	–	1.645	12.262	–	–	62.694.586	2.796.817	8.334.033
		2.090.931	2.031	12.675	–	–	62.749.543	2.796.817	8.334.271
Quellensteuern	1	62.192.435	–	71.831	317.930	8.953	–	–	487.232
Kapitalertragsteuer	1	–	–	(490)	–	–	–	–	(63.251)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(1.540.194.835)	(1.909.151)	(2.761.487)	(59.481.807)	(453.862)	(957.216.843)	(64.567.471)	(215.702.831)

\* Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Sustainable Asia High Yield Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* US\$	Systematic Global Sustainable Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Ultra Short Term Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Uncorrelated Strategies Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	XXXXXXXXXXXX Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** US\$	US Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	2.538.288	5.944.374	5.638.541	7.219	21.554.078	11.033.398	1.912.636	15.809
Dividendenerträge	1	–	–	–	1.514.896	–	–	38	242.296
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	151	–	410	36.550	–	–	2.477
Sonstige Erträge		–	64	–	485	3.743	1.107.014	273	756
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(18.519.194)	(28.879.284)	(21.709.100)	(5.399.900)	(78.146.103)	77.671.657	4.170.627	(5.354.167)
		(15.980.906)	(22.934.695)	(16.070.559)	(3.876.890)	(56.551.732)	89.812.069	6.083.574	(5.092.829)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	198.639	836.649	386.207	117.742	1.556.522	18.385.164	3.988.226	148.193
Vertriebsgebühren	6	–	27.424	–	4.586	211	190.442	–	60
Verwaltungsgebühren	6	61.962	149.105	67.923	67.551	500.760	2.874.345	303.853	41.720
Bereitstellungsprovision	19	458	16.486	2.145	7.706	148.736	365.564	9.457	3.100
Depotgebühren	6	12.316	12.978	11.419	12.978	87.036	320.288	25.474	12.578
Gebühren der Verwahrstelle	6	1.352	5.695	3.564	2.335	52.628	274.758	18.195	1.056
Honorare	9	114.191	136.208	81.203	100.404	96.997	571.729	70.868	44.023
Honorare der Direktoren	7	5.536	6.008	4.693	4.408	4.289	4.413	3.292	4.408
Erfolgsabhängige Gebühr	6	–	–	–	–	–	75.878.127	1.351	–
Transaktionskosten	9	23.533	35.949	12.589	186.029	151.594	21.937.585	2.244.454	13.626
Gründungs aufwendungen	9	–	–	34.116	–	–	–	105.495	–
Prüfungshonorare	8	4.007	5.338	9.712	6.053	6.235	6.380	9.787	2.448
Umsatzsteuerentlastung		(331)	(602)	(659)	(208)	(5.258)	(15.957)	–	(63)
Sonstige Aufwendungen	9	6.090	7.507	8.245	6.957	6.891	5.579.817	370.398	8.544
Kostenverzicht	6	(160.143)	(165.230)	(53.094)	(134.803)	–	–	–	(81.644)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		267.610	1.073.515	568.063	381.738	2.606.641	126.372.655	7.150.850	198.049
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		45	7.376	1.319	274	–	174.016	20.681	1.209
Gezahlte Ausschüttungen	1	270.363	286.367	–	–	22.323	–	–	–
		270.408	293.743	1.319	274	22.323	174.016	20.681	1.209
Quellensteuern	1	12.927	28	108.561	287.847	14.929	4.333.351	134.918	66.696
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(16.531.851)	(24.301.981)	(16.748.502)	(4.546.749)	(59.195.625)	(41.067.953)	(1.222.875)	(5.358.783)

\* Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.

\*\* Der XXXXXXXXXXXX Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	US Equity Index PutWrite Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	US Large Cap Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	4.282.751	780.830	960.562	28.718	175.899	161.231	172.395	991.009.766
Dividenerträge	1	–	22.063.565	2.999.980	7.826.211	27.655.707	5.705.571	1.283.944	109.148.302
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	–	67.468	–	–	–	–	611.992
Sonstige Erträge		–	–	99.423	–	–	9.340	–	4.987.703
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(87.672.202)	(27.395.274)	(36.844.968)	(150.019.669)	(301.673.396)	(155.375.348)	(39.191.641)	(6.379.690.095)
		(83.389.451)	(4.550.879)	(32.717.535)	(142.164.740)	(273.841.790)	(149.499.206)	(37.735.302)	(5.273.932.332)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	2.579.752	4.595.988	3.334.050	7.378.299	11.237.220	6.754.678	1.555.235	220.981.106
Vertriebsgebühren	6	13.247	119.897	41.179	909.109	2.002.809	729.500	5.331	11.861.633
Verwaltungsgebühren	6	365.241	473.775	193.545	514.127	1.401.818	462.685	133.735	21.323.731
Bereitstellungsprovision	19	85.448	21.713	31.545	92.632	122.751	78.869	25.463	3.978.990
Depotgebühren	6	11.978	14.473	12.000	12.678	13.121	13.116	12.578	3.500.933
Gebühren der Verwahrstelle	6	30.355	31.007	12.921	31.614	41.239	30.452	9.069	1.640.283
Honorare	9	102.534	100.402	65.729	138.031	188.463	132.690	55.026	5.741.188
Honorare der Direktoren	7	4.408	5.636	4.408	4.413	5.408	6.008	5.608	259.448
Erfolgsabhängige Gebühr	6	–	–	–	–	–	–	–	75.968.663
Transaktionskosten	9	129.938	570.124	172.070	282.497	502.855	283.573	89.127	36.341.706
Gründungs aufwendungen	9	–	–	–	–	–	–	–	248.619
Prüfungshonorare	8	4.727	5.832	5.893	4.670	2.286	3.785	7.040	321.771
Umsatzsteuerentlastung		(2.475)	(4.523)	(1.273)	(3.192)	(4.326)	(2.706)	(763)	(157.381)
Sonstige Aufwendungen	9	9.112	11.137	84.198	10.161	12.037	12.304	14.150	6.586.467
Kostenverzicht	6	–	–	–	–	–	–	–	(2.876.095)
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	–	–	–	–	(227.107)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		3.334.265	5.945.461	3.956.265	9.375.039	15.525.681	8.504.954	1.911.599	385.493.955
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		–	69.033	2	3.133	821	2.396	–	436.593
Gezahlte Ausschüttungen	1	5.382.746	–	–	13.581	7.297.490	–	–	282.296.687
		5.382.746	69.033	2	16.714	7.298.311	2.396	–	282.733.280
Quellensteuern	1	–	5.986.352	764.464	2.248.107	7.595.368	1.678.872	334.116	33.280.542
Kapitalertragsteuer	1	–	–	–	–	–	–	–	(1.666.490)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(92.106.462)	(16.551.725)	(37.438.266)	(153.804.600)	(304.261.150)	(159.685.428)	(39.981.017)	(5.973.773.619)

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, der am 20. Dezember 2021 aufgelöst wurde. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Geschäftsjahr.

\* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.



## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		5G Connectivity	Absolute Return Multi Strategy	Asian Debt - Hard Currency	China A-Share Equity	China Bond	China Equity	CLO Income	Corporate Hybrid Bond
	Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 CNY	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 CNY	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 EUR
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	3.891	73.811	707.921	–	27.961.733	–	7.629.337	76.482.261
Dividendenerträge	1	15.269.670	132.283	–	246.087	–	13.813.966	–	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	–	731	–	35.674	–	–	95.248
Sonstige Erträge		2.125	154.486	34	20.890	82.133	29.359	14.287	7.872
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	85.899.683	(2.477.038)	(783.700)	(315.607)	(44.354.125)	(30.894.428)	1.294.815	(2.741.937)
		101.175.369	(2.116.458)	(75.014)	(48.630)	(16.274.585)	(17.051.103)	8.938.439	73.843.444
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	32.629.280	780.061	142.225	188.411	1.433.295	8.521.847	829.150	14.447.855
Vertriebsgebühren	6	1.430.402	10.949	20.557	–	7.487	494.352	–	313.571
Verwaltungsgebühren	6	1.527.053	316.349	73.624	160.295	746.675	394.712	85.119	1.230.925
Bereitstellungsprovision	19	369.517	7.583	2.524	2.232	42.374	91.033	17.365	261.827
Depotgebühren	6	341.624	815	12.003	75.217	461.485	156.053	12.000	160.215
Gebühren der Verwahrstelle	6	118.103	1.923	766	1.089	25.761	26.730	–	117.182
Honorare	9	276.515	107.711	72.833	133.799	687.574	153.162	78.945	209.574
Honorare der Direktoren	7	5.577	5.696	5.820	36.040	35.988	5.576	5.577	4.704
Transaktionskosten	9	5.357.573	205.803	14.134	162.065	426.009	1.374.607	8.261	92.427
Gründungsaufwendungen	9	15.307	–	–	–	–	–	3.532	–
Prüfungshonorare	8	17.527	–	7.910	80.227	301.408	16.889	13.508	15.916
Umsatzsteuerentlastung		(29.619)	(708)	(224)	(251)	(7.997)	(8.842)	(1.801)	(30.251)
Sonstige Aufwendungen	9	130.752	165.302	2.741	–	–	3.519	22.268	600.152
Kostenverzicht	6	–	(275.301)	(154.022)	(562.759)	(1.168.371)	–	–	–
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		42.189.611	1.326.183	200.891	276.365	2.991.688	11.229.638	1.073.924	17.424.097
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		–	66	8	100	10.089	36	773	373
Gezahlte Ausschüttungen	1	–	–	429.281	–	554.496	7.669	4.967.660	13.429.620
		–	66	429.289	100	564.585	7.705	4.968.433	13.429.993
Quellensteuern	1	2.731.448	65.665	8	24.721	–	1.053.494	–	–
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		56.254.310	(3.508.372)	(705.202)	(349.816)	(19.830.858)	(29.341.940)	2.896.082	42.989.354

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Diversified Currency Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021* US\$	Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Emerging Markets Select Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge	1	10	200.211.149	131.963.956	63.670.462	1.202.912	791	259
Dividendenerträge	1	–	–	–	–	–	10.756.966	3.208.769
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	6.294	–	4.833	–	3.062	525
Sonstige Erträge		10.215	13.667	317.508	89.181	18.335	2.171	92.940
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	2.643	(441.576.384)	(366.337.022)	(151.607.501)	(3.180.023)	(23.337.498)	(5.978.144)
		12.868	(241.345.274)	(234.055.558)	(87.843.025)	(1.958.776)	(12.574.508)	(2.675.651)
<b>Aufwendungen</b>								
Managementgebühr	6	446	31.170.887	19.012.636	8.505.026	169.811	6.062.306	1.210.754
Vertriebsgebühren	6	17	530.513	1.730.340	70.997	–	1.197.615	–
Verwaltungsgebühren	6	11.347	2.441.022	2.007.298	923.224	104.935	449.771	106.093
Bereitstellungsprovision	19	–	494.177	350.078	190.334	3.398	64.253	18.753
Depotgebühren	6	–	330.560	1.709.677	449.680	12.037	204.558	63.149
Gebühren der Verwahrstelle	6	4	216.163	139.290	54.438	1.925	20.932	7.841
Honorare	9	2.660	342.323	304.380	223.255	76.048	178.733	78.257
Honorare der Direktoren	7	–	5.576	5.577	5.577	5.576	5.576	5.576
Transaktionskosten	9	–	356.541	1.370.620	735.818	78.393	1.338.120	342.450
Prüfungshonorare	8	8.897	17.656	29.648	8.668	464	18.588	8.593
Umsatzsteuerentlastung		(6)	(53.594)	(33.040)	(16.482)	(415)	(6.458)	(1.929)
Sonstige Aufwendungen	9	118	176.461	252	22.715	534	28.405	15.711
Kostenverzicht	6	(12.754)	–	(125.776)	–	(183.008)	–	–
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		10.729	36.028.285	26.500.980	11.173.250	269.698	9.562.399	1.855.248
<b>Finanzierungskosten</b>								
Zinsaufwendungen		–	1.953	8.715	12.609	175	3.557	279
Gezahlte Ausschüttungen	1	–	52.264.343	47.872.609	9.731.631	–	375.183	153
		–	52.266.296	47.881.324	9.744.240	175	378.740	432
Quellensteuern	1	–	199.337	7.502.350	1.923.027	43.339	1.069.674	327.757
Kapitalertragsteuer	1	–	–	(2.380.948)	(797.028)	(256)	2.283.604	(20.903)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		2.139	(329.839.192)	(313.559.264)	(109.886.514)	(2.271.732)	(25.868.925)	(4.838.185)

\* Der Diversified Currency wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		Euro Bond Absolute Return	Euro Opportunistic Bond	European High Yield Bond	European Sustainable Equity Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021*	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Index PutWrite Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021**	Global Equity Megatrends
	Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021* EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021** US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	1.019.219	240.754	1.504.430	–	4.611.357	11.214.379	340.163	76
Dividenden erträge	1	–	–	–	168.012	–	–	–	503.073
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	2.340	–	5.066	–	96	–	–	–
Sonstige Erträge		26.947	63	162	–	842	1.363	106	25.802
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	1.810.361	(74.655)	2.309.206	1.277.570	(13.609.970)	(10.044.746)	1.190.168	4.172.980
		2.858.867	166.162	3.818.864	1.445.582	(8.997.675)	1.170.996	1.530.437	4.701.931
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	121.371	39.260	112.948	130.619	31.608	1.360.294	63.974	914.369
Vertriebsgebühren	6	–	–	3.810	203	19.933	–	2.596	203.114
Verwaltungsgebühren	6	62.036	42.071	92.611	25.056	214.643	167.082	80.803	86.898
Bereitstellungsprovision	19	6.825	1.528	4.400	1.291	29.745	43.926	3.359	5.522
Depotgebühren	6	10.133	10.133	10.133	8.683	12.217	11.977	12.976	12.003
Gebühren der Verwahrstelle	6	2.130	504	1.774	1.093	8.007	13.448	202	2.701
Honorare	9	45.896	46.769	90.675	70.482	103.718	91.831	183.049	96.381
Honorare der Direktoren	7	4.704	4.704	4.704	4.865	5.577	5.576	5.757	5.577
Transaktionskosten	9	16.952	8.412	19.816	212.677	70.480	1.116	29.835	48.193
Gründungsaufwendungen	9	–	–	–	40.043	–	–	–	–
Prüfungshonorare	8	11.576	11.088	13.665	15.405	9.598	18.812	23.363	13.914
Umsatzsteuerentlastung		(614)	(146)	(433)	(229)	(2.863)	(3.262)	(235)	(625)
Sonstige Aufwendungen	9	14.253	11.409	9.370	8.696	16.077	5.802	5.335	9.758
Kostenverzicht	6	(29.446)	(111.431)	(167.027)	(117.113)	(12)	–	(306.109)	(45.722)
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		265.816	64.301	196.446	401.771	518.728	1.716.602	104.905	1.352.083
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		1.040	43	1	7	139	–	11	621
Gezahlte Ausschüttungen	1	184.734	152.982	75.313	–	2.838	9.116.653	82.761	–
		185.774	153.025	75.314	7	2.977	9.116.653	82.772	621
Quellensteuern	1	–	–	–	16.776	–	–	–	84.710
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		2.407.277	(51.164)	3.547.104	1.027.028	(9.519.380)	(9.662.259)	1.342.760	3.264.517

\* Der European Sustainable Equity wurde am 24. Februar 2021 aufgelegt.

\*\* Der Global Equity Index PutWrite wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		Global Flexible Credit Income	Global High Yield SDG Engagement	Global High Yield Sustainable Action	Global Investment Grade Credit Berichtszeitraum	Global Opportunistic Bond	Global Real Estate Securities	Global Sustainable Equity Berichtszeitraum	High Yield Bond
	Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021** US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	29.413.218	3.536.603	806.050	831.836	2.979.384	–	24	177.165.550
Dividenerträge	1	18.199	–	–	–	217.661	644.985	429.390	1.767.792
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	8.219	2.962	–	–	2.131	–	–	483.013
Sonstige Erträge		10.283	142	441	–	29	–	–	25.577
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(13.479.591)	(2.797.745)	(191.011)	(1.901.388)	(2.162.923)	4.648.074	9.574.509	(55.636.160)
		15.970.328	741.962	615.480	(1.069.552)	1.036.282	5.293.059	10.003.923	123.805.772
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	1.962.632	274.952	91.659	16.444	229.306	189.025	350.593	30.257.423
Vertriebsgebühren	6	13.061	14.482	–	–	7.845	13.314	53.433	3.133.796
Verwaltungsgebühren	6	343.251	124.815	58.165	19.526	159.536	66.719	50.582	2.868.284
Bereitstellungsprovision	19	72.351	8.056	2.174	–	11.826	2.352	3.988	432.298
Depotgebühren	6	21.051	12.003	12.010	2.010	12.003	12.010	10.179	45.621
Gebühren der Verwahrstelle	6	32.524	2.637	897	822	4.863	591	3.123	139.010
Honorare	9	164.358	85.161	73.371	28.669	96.412	76.608	84.841	481.300
Honorare der Direktoren	7	5.576	5.577	5.576	1.904	5.576	5.577	5.743	5.577
Transaktionskosten	9	50.087	26.786	5.387	3.915	73.232	125.566	189.117	245.810
Gründungsaufwendungen	9	–	–	–	41.506	–	–	48.574	–
Prüfungshonorare	8	14.670	8.655	13.468	4.902	8.440	12.141	14.826	39.033
Umsatzsteuerentlastung		(7.881)	(840)	(219)	–	(1.216)	(236)	(565)	(43.294)
Sonstige Aufwendungen	9	33.286	5.003	6.870	3.772	20.738	3.384	10.512	99
Kostenverzicht	6	–	(143.827)	(161.127)	(22.790)	(157.999)	(165.622)	(74.966)	–
Verzicht auf Gebühren	6	(2.419)	–	–	–	(1.204)	–	–	(243.753)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		2.702.547	423.460	108.231	100.680	469.358	341.429	749.980	37.361.204
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		–	37	40	26	249	297	1.197	14
Gezahlte Ausschüttungen	1	4.044	99.015	553.047	–	198.461	40.774	–	112.434.330
		4.044	99.052	553.087	26	198.710	41.071	1.197	112.434.344
Quellensteuern	1	336.449	1.551	3	23.641	3.926	120.664	84.846	135.313
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		12.927.288	217.899	(45.841)	(1.193.899)	364.288	4.789.895	9.167.900	(26.125.089)

\* Der Global Investment Grade Credit wurde am 1. September 2021 aufgelegt.

\*\* Der Global Sustainable Equity wurde am 24. Februar 2021 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		InnovAsia 5G Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021* US\$	Japan Equity Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 JPY	Macro Opportunities FX Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 EUR	Multi-Asset Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Multi-Style Premia Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021** US\$	Next Generation Mobility Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Short Duration Emerging Market Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Short Duration High Yield SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$
	Anm.								
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	3	–	457.899	384.661	115	477	273.030.987	38.088.916
Dividenerträge	1	73.596	96.744.896	–	309.047	53	1.082.047	–	132.883
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	–	–	–	5	–	72.262	34.462
Sonstige Erträge		–	64.134	13.889	188	47.819	46.151	41.566	6.705
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	2.529.164	(208.802.302)	284.894	751.526	16.408	33.014.206	(548.525.999)	(39.330.478)
		2.602.763	(111.993.272)	756.682	1.445.422	64.400	34.142.881	(275.381.184)	(1.067.512)
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	88.088	39.507.362	111.330	201.773	6.161	2.243.654	37.468.114	4.505.707
Vertriebsgebühren	6	67	–	164	55.402	–	374.638	1.212.577	102.458
Verwaltungsgebühren	6	13.399	6.766.674	70.156	140.143	37.209	168.794	3.463.722	491.572
Bereitstellungsprovision	19	609	1.757.279	4.273	2.420	669	15.915	844.517	104.791
Depotgebühren	6	3.144	1.349.487	10.154	12.014	2.869	12.010	488.225	12.048
Gebühren der Verwahrstelle	6	225	329.047	1.845	453	66	8.614	347.616	30.098
Honorare	9	37.629	16.259.498	74.993	76.721	20.698	117.278	358.032	176.587
Honorare der Direktoren	7	2.885	621.135	4.704	5.576	1.835	5.577	5.576	5.577
Transaktionskosten	9	103.669	13.360.591	36.374	105.923	11.726	78.399	194.345	60.911
Gründungsaufwendungen	9	42.635	812.889	–	–	–	–	–	–
Prüfungshonorare	8	8.301	2.006.317	12.742	9.830	15.620	13.886	18.956	29.702
Umsatzsteuerentlastung		(53)	(65.717)	(446)	(246)	(39)	(1.947)	(83.254)	(9.160)
Sonstige Aufwendungen	9	8.821	579.726	44.775	5.288	121	7.296	148.885	33.682
Kostenverzicht	6	(90.110)	(7.216.327)	(179.146)	(306.570)	(63.630)	–	–	–
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	–	–	–	–	(18.323)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		219.309	76.067.961	191.918	308.727	33.305	3.044.114	44.467.311	5.525.650
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		–	58.566	207	188	–	35	2.898	–
Gezahlte Ausschüttungen	1	–	–	104	17.898	–	–	62.816.747	8.322.838
		–	58.566	311	18.086	–	35	62.819.645	8.322.838
Quellensteuern	1	12.747	14.511.737	10.515	32.603	594	209.465	–	–
Kapitalertragsteuer	1	–	–	–	1.057	–	–	–	–
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		2.370.707	(202.631.536)	553.938	1.084.949	30.501	30.889.267	(382.668.140)	(14.916.000)

\* Der InnovAsia 5G wurde am 14. Juli 2021 aufgelegt.

\*\* Der Multi-Style Premia wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		Strategic Income	Sustainable Asia High Yield Berichtszeitraum	Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Systematic Global Sustainable Value	Ultra Short Term Euro Bond	Uncorrelated Strategies	US Equity	US Equity Index PutWrite
	Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	zum 31. Dezember 2021* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Erträge</b>									
Zinserträge	1	49.019.442	57.145	7.027.152	1	9.196.498	1.199.062	18	5.198.107
Dividendenerträge	1	39.705	–	–	292.335	–	–	68.468	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	36.475	–	1.214	10	48.554	–	4	–
Sonstige Erträge		114.492	–	104	387	50.662	809.774	62	7
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(39.279.898)	(289.447)	(14.050.637)	1.580.037	2.276.535	2.326.203	1.496.209	51.732.863
		9.930.216	(232.302)	(7.022.167)	1.872.770	11.572.249	4.335.039	1.564.761	56.930.977
<b>Aufwendungen</b>									
Managementgebühr	6	9.343.841	7.332	1.134.085	19.653	1.038.759	15.070.948	63.090	1.523.794
Vertriebsgebühren	6	1.277.768	–	61.834	9.468	121	213.010	–	12.998
Verwaltungsgebühren	6	1.092.249	2.100	209.050	40.442	394.662	2.327.581	32.778	270.680
Bereitstellungsprovision	19	171.041	–	20.674	1.215	82.380	266.614	926	49.863
Depotgebühren	6	39.121	297	12.080	12.003	56.969	231.028	12.003	11.965
Gebühren der Verwahrstelle	6	59.624	30	6.662	299	37.149	187.653	414	18.234
Honorare	9	229.782	3.298	172.914	100.348	97.709	495.037	58.669	130.318
Honorare der Direktoren	7	5.576	256	5.576	5.577	6.004	5.577	5.577	5.577
Erfolgsabhängige Gebühr	6	–	–	–	–	–	16.881.103	–	–
Transaktionskosten	9	208.849	425	42.317	53.480	69.154	14.515.326	6.362	62.093
Gründungsaufwendungen	9	–	33.768	–	–	–	–	–	–
Prüfungshonorare	8	43.603	16.199	10.790	7.189	10.286	6.456	15.357	18.066
Umsatzsteuerentlastung		(17.112)	–	(1.965)	(117)	(8.820)	(27.111)	(96)	(3.966)
Sonstige Aufwendungen	9	115	415	5.374	5.629	277.117	4.440.157	5.053	2.303
Kostenverzicht	6	–	(21.372)	(202.609)	(170.500)	(4)	–	(119.022)	(5.002)
Verzicht auf Gebühren	6	(5.278)	–	–	–	–	–	–	–
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		12.449.179	42.748	1.476.782	84.686	2.061.486	54.613.379	81.111	2.096.923
<b>Finanzierungskosten</b>									
Zinsaufwendungen		613	–	2.105	500	667	3.121.383	–	–
Gezahlte Ausschüttungen	1	13.950.926	–	426.587	–	5.023	–	–	180.664
		13.951.539	–	428.692	500	5.690	3.121.383	–	180.664
Quellensteuern	1	443.788	3.673	46	45.867	50.412	3.558.816	18.133	–
Kapitalertragsteuer	1	(31.591)	–	–	–	–	–	–	–
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		(16.882.699)	(278.723)	(8.927.687)	1.741.717	9.454.661	(56.958.539)	1.465.517	54.653.390

\* Der Sustainable Asia High Yield wurde am 13. Dezember 2021 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	US Large Cap Value Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021* US\$	US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge	1	1	603.303	216	295	511	2.047	1.120.436.010
Dividenerträge	1	1.341	5.117.301	8.003.238	18.520.917	6.647.862	622.103	88.790.739
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	12.582	–	–	–	–	853.215
Sonstige Erträge		–	10.998	6.177	46.546	40.815	989	2.115.999
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	78.675	5.921.741	154.390.210	203.405.524	118.055.604	28.098.480	(1.062.090.513)
		80.017	11.665.925	162.399.841	221.973.282	124.744.792	28.723.619	150.105.450
<b>Aufwendungen</b>								
Managementgebühr	6	433	5.308.738	7.945.396	8.610.409	9.559.201	1.143.598	268.553.811
Vertriebsgebühren	6	–	58.187	972.136	1.474.194	1.244.256	2.926	16.396.274
Verwaltungsgebühren	6	429	320.315	647.155	1.060.482	691.605	97.613	26.257.740
Bereitstellungsprovision	19	–	57.728	85.230	68.379	86.606	12.833	4.466.240
Depotgebühren	6	181	12.010	12.266	12.190	12.786	12.003	4.788.950
Gebühren der Verwahrstelle	6	2	25.243	28.258	34.053	43.670	5.588	1.792.081
Honorare	9	2.136	68.650	195.051	289.335	171.457	70.227	7.261.929
Honorare der Direktoren	7	156	5.576	5.577	5.008	5.576	5.576	270.968
Erfolgsabhängige Gebühr	6	–	355.899	–	–	–	–	17.237.002
Transaktionskosten	9	324	246.611	269.868	388.294	239.966	85.163	29.476.622
Gründungsaufwendungen	9	33.768	–	–	–	–	–	273.633
Prüfungshonorare	8	14.260	13.862	19.644	22.783	20.585	11.588	831.432
Umsatzsteuerentlastung		–	(5.865)	(8.786)	(7.559)	(9.943)	(1.665)	(443.525)
Sonstige Aufwendungen	9	284	187.354	–	6.812	2.568	8.831	6.705.661
Kostenverzicht	6	(18.015)	–	–	–	–	–	(3.873.775)
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	–	–	–	(270.977)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		33.958	6.654.308	10.171.795	11.964.380	12.068.333	1.454.281	379.724.066
<b>Finanzierungskosten</b>								
Zinsaufwendungen		–	–	455	3.197	3.685	207	3.170.945
Gezahlte Ausschüttungen	1	–	–	7.651	4.881.847	–	–	345.246.571
		–	–	8.106	4.885.044	3.685	207	348.417.516
Quellensteuern	1	359	1.328.612	2.291.485	4.539.348	1.967.287	165.838	30.553.663
Kapitalertragsteuer	1	–	–	–	–	–	–	(946.065)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>		45.700	3.683.005	149.928.455	200.584.510	110.705.487	27.103.293	(607.643.730)

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, Diversified Currency, Global Equity Index PutWrite und Multi-Style Premia, die am 20. Dezember 2021, 22. Januar 2021, 20. Dezember 2021 bzw. 24. Februar 2021 aufgelöst wurden. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Geschäftsjahr.

\* Der US Large Cap Value wurde am 20. Dezember 2021 aufgelegt.

\*\* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

# Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens

	5G Connectivity	Absolute Return Multi Strategy	Asian Debt - Hard Currency	China A-Share Equity	China Bond	China Equity	CLO Income	Commodities Berichtszeitraum zum
Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022*	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	31. Dezember 2022**
	US\$	US\$	US\$	CNY	CNY	US\$	US\$	US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	2.395.521.641	–	14.429.520	24.427.958	580.753.658	529.341.191	149.839.432	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(961.044.302)	–	(1.763.858)	(5.664.222)	(9.221.023)	(115.468.447)	(24.133.828)	(1.611.554)
Zeichnungen	5 197.172.123	–	18.601.061	133.524	47.011.277	200.374	30.409.011	104.395.961
Rücknahmen	5 (638.639.269)	–	(9.640.514)	(2.655.502)	(165.500.333)	(96.659.442)	(18.077.151)	(16.786.978)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	993.010.193	–	21.626.209	16.241.758	453.043.579	317.413.676	138.037.464	85.997.429

	Corporate Hybrid Bond	Emerging Market Debt - Hard Currency	Emerging Market Debt - Local Currency	Emerging Market Debt Blend	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Emerging Markets Equity	Emerging Markets Select Equity	Euro Bond Absolute Return
Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022
	EUR	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	2.458.411.975	3.612.575.490	2.102.682.652	947.581.444	47.386.279	388.690.425	125.356.269	54.164.845
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(312.428.965)	(809.494.034)	(309.993.190)	(167.989.052)	(8.895.817)	(104.473.315)	(30.931.205)	(1.736.050)
Zeichnungen	5 845.732.739	1.181.314.266	200.530.321	109.802.796	25.051.224	75.505.768	2.830.898	21.594.998
Rücknahmen	5 (1.209.560.941)	(1.492.690.794)	(606.955.340)	(419.213.708)	(9.267.305)	(167.915.123)	(3.493.840)	(25.495.917)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	1.782.154.808	2.491.704.928	1.386.264.443	470.181.480	54.274.381	191.807.755	93.762.122	48.527.876

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.



## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Euro Opportunistic Bond	European High Yield Bond	European Sustainable Equity	Event Driven Berichtszeitraum	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Megatrends	Global Flexible Credit Income
Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	zum 31. Dezember 2022* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	11.211.336	38.865.311	113.886.075	–	180.397.378	233.747.409	83.153.849	705.212.784
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(1.966.594)	(988.986)	(33.987.505)	1.367.575	(26.483.421)	(16.359.564)	(12.624.827)	(125.406.084)
Zeichnungen	5 50.000	14.163.971	152.610.854	40.079.097	14.765.120	19.901	37.435.263	107.028.934
Rücknahmen	5 –	(19.585.768)	(56.655.194)	–	(33.867.781)	(57.011.660)	(28.619.920)	(292.309.305)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	9.294.742	32.454.528	175.854.230	41.446.672	134.811.296	160.396.086	79.344.365	394.526.329

	Global High Yield SDG Engagement	Global High Yield Sustainable Action	Global Investment Grade Credit	Global Opportunistic Bond	Global Real Estate Securities	Global Sustainable Equity	High Yield Bond	InnovAsia 5G
Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	39.627.349	17.600.553	98.810.202	94.244.831	50.887.571	203.986.580	3.203.355.473	26.794.987
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(19.630.150)	(2.553.485)	(14.114.027)	(11.514.126)	(15.907.263)	(68.031.509)	(466.324.580)	(12.069.745)
Zeichnungen	5 420.495.825	–	1.212.467	22.054.010	21.873.961	123.872.119	663.733.644	6.308.354
Rücknahmen	5 (103.539.646)	–	–	(28.679.272)	(17.831.849)	(128.248.991)	(1.102.012.825)	(6.284.603)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	336.953.378	15.047.068	85.908.642	76.105.443	39.022.420	131.578.199	2.298.751.712	14.748.993

\* Der Event Driven wurde am 26. Oktober 2022 aufgelegt.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Multi-Asset Income	Next Generation Mobility	Next Generation Space Economy Berichtszeitraum	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement	Strategic Income
Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 JPY	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	zum 31. Dezember 2022* US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	12.105.937.644	44.609.891	22.705.351	220.483.316	–	6.934.454.095	644.439.910	1.444.921.523
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(1.540.194.835)	(1.909.151)	(2.761.487)	(59.481.807)	(453.862)	(957.216.843)	(64.567.471)	(215.702.831)
Zeichnungen	5 16.188.114.198	20.283.746	1.394.430	39.564.733	8.972.341	1.374.964.811	191.676.597	469.594.244
Rücknahmen	5 (6.211.189.422)	(31.474.330)	(9.972.179)	(52.561.565)	(27.617)	(2.227.540.313)	(215.175.357)	(376.007.081)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	20.542.667.585	31.510.156	11.366.115	148.004.677	8.490.862	5.124.661.750	556.373.679	1.322.805.855

	Sustainable Asia High Yield	Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Berichtszeitraum	Systematic Global Sustainable Value	Ultra Short Term Euro Bond	Uncorrelated Strategies	XXXXXXXXXXXX Berichtszeitraum	US Equity
Anm.	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	zum 31. Dezember 2022** US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	zum 31. Dezember 2022*** US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	24.721.277	145.057.425	–	20.888.250	1.160.670.538	2.578.359.212	–	8.931.605
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(16.531.851)	(24.301.981)	(16.748.502)	(4.546.749)	(59.195.625)	(41.067.953)	(1.222.875)	(5.358.783)
Zeichnungen	5 92.794.221	20.402.615	189.296.638	74.254.494	683.149.224	1.666.039.977	735.655.808	29.146.487
Rücknahmen	5 (69.061.376)	(42.913.751)	(14.127.542)	(42.571.554)	(963.234.070)	(1.072.844.254)	(22.490.223)	(1.254.480)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	31.922.271	98.244.308	158.420.594	48.024.441	821.390.067	3.130.486.982	711.942.710	31.464.829

\* Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

\*\* Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.

\*\* Der XXXXXXXXXXXXX Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	US Equity Index PutWrite	US Large Cap Value	US Long Short Equity	US Multi Cap Opportunities	US Real Estate Securities	US Small Cap	US Small Cap Intrinsic Value	Fonds insgesamt*
	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$
Anm.								
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	475.077.135	2.045.700	474.020.776	781.225.671	1.022.296.968	822.142.195	153.622.426	35.433.928.751
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(92.106.462)	(16.551.725)	(37.438.266)	(153.804.600)	(304.261.150)	(159.685.428)	(39.981.017)	(5.973.773.619)
Wechselkursbewegung	–	–	–	–	–	–	–	304.151.197)
Zeichnungen	5 447.110.889	1.918.802.436	104.119.789	199.217.907	413.904.299	359.181.498	105.049.569	13.810.902.186
Rücknahmen	5 (149.624.824)	(136.342.052)	(319.172.398)	(385.323.028)	(483.914.322)	(429.259.598)	(24.649.938)	(13.852.523.900)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	680.456.738	1.767.954.359	221.529.901	441.315.950	648.025.795	592.378.667	194.041.040	29.114.382.221

\* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	5G Connectivity	Absolute Return Multi Strategy	Asian Debt - Hard Currency	China A-Share Equity	China Bond	China Equity	CLO Income	Corporate Hybrid Bond
	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021*	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021
Anm.	US\$	US\$	US\$	CNY	CNY	US\$	US\$	EUR
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	1.424.177.168	57.639.245	18.157.386	15.947.109	576.978.891	712.806.715	115.488.089	1.706.483.209
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	56.254.310	(3.508.372)	(705.202)	(349.816)	(19.830.858)	(29.341.940)	2.896.082	42.989.354
Zeichnungen	5 1.789.884.877	5.593.185	2.921.093	14.415.929	325.626.685	85.171	98.958.398	1.486.648.826
Rücknahmen	5 (874.794.714)	(59.724.058)	(5.943.757)	(5.585.264)	(302.021.060)	(154.208.755)	(67.503.137)	(777.709.414)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	2.395.521.641	–	14.429.520	24.427.958	580.753.658	529.341.191	149.839.432	2.458.411.975

	Diversified Currency	Emerging Market Debt - Hard Currency	Emerging Market Debt - Local Currency	Emerging Market Debt Blend	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Emerging Markets Equity	Emerging Markets Select Equity	Euro Bond Absolute Return
	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021**	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021
Anm.	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	1.311.592	4.101.353.367	2.871.317.017	1.489.675.714	8.715.580	488.683.338	158.243.645	44.952.903
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	2.139	(329.839.192)	(313.559.264)	(109.886.514)	(2.271.732)	(25.868.925)	(4.838.185)	2.407.277
Zeichnungen	5 –	2.125.254.282	1.142.023.858	525.606.837	42.356.405	194.205.691	6.043.549	14.733.024
Rücknahmen	5 (1.313.731)	(2.284.192.967)	(1.597.098.959)	(957.814.593)	(1.413.974)	(268.329.679)	(34.092.740)	(7.928.359)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	–	3.612.575.490	2.102.682.652	947.581.444	47.386.279	388.690.425	125.356.269	54.164.845

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Der Diversified Currency wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Euro Opportunistic Bond	European High Yield Bond	European Sustainable Equity Berichtszeitraum	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Index PutWrite Berichtszeitraum	Global Equity Megatrends	Global Flexible Credit Income
	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	zum 31. Dezember 2021*	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	zum 31. Dezember 2021**	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021
Anm.	EUR	EUR	EUR	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	11.262.500	32.824.336	–	250.148.124	270.368.674	29.020.111	27.606.352	609.645.100
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(51.164)	3.547.104	1.027.028	(9.519.380)	(9.662.259)	1.342.760	3.264.517	12.927.288
Zeichnungen	5	16.238.066	115.972.884	33.137.402	–	1.581.978	66.135.745	229.862.240
Rücknahmen	5	(13.744.195)	(3.113.837)	(93.368.768)	(26.959.006)	(31.944.849)	(13.852.765)	(147.221.844)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	11.211.336	38.865.311	113.886.075	180.397.378	233.747.409	–	83.153.849	705.212.784

	Global High Yield SDG Engagement	Global High Yield Sustainable Action	Global Investment Grade Credit Berichtszeitraum	Global Opportunistic Bond	Global Real Estate Securities	Global Sustainable Equity Berichtszeitraum	High Yield Bond	InnovAsia 5G Berichtszeitraum
	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	zum 31. Dezember 2021***	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	zum 31. Dezember 2021****	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	zum 31. Dezember 2021*****
Anm.	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	63.585.258	14.646.394	–	97.797.455	6.618.831	–	3.708.355.497	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	217.899	(45.841)	(1.193.899)	364.288	4.789.895	9.167.900	(26.125.089)	2.370.707
Zeichnungen	5	3.000.000	100.004.101	20.936.832	44.517.745	213.257.358	1.430.426.378	25.191.223
Rücknahmen	5	(53.342.045)	–	(24.853.744)	(5.038.900)	(18.438.678)	(1.909.301.313)	(766.943)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	39.627.349	17.600.553	98.810.202	94.244.831	50.887.571	203.986.580	3.203.355.473	26.794.987

\* Der European Sustainable Equity wurde am 24. Februar 2021 aufgelegt.

\*\* Der Global Equity Index PutWrite wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\*\* Der Global Investment Grade Credit wurde am 1. September 2021 aufgelegt.

\*\*\*\* Der Global Sustainable Equity wurde am 24. Februar 2021 aufgelegt.

\*\*\*\*\* Der InnovAsia 5G wurde am 14. Juli 2021 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Multi-Asset Income	Multi-Style Premia Berichtszeitraum	Next Generation Mobility	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement	Strategic Income
	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	zum 31. Dezember 2021*	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021
Anm.	JPY	EUR	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	738.936.374	26.321.516	18.205.057	9.524.659	77.072.523	6.173.869.573	927.728.289	1.234.787.335
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(202.631.536)	553.938	1.084.949	30.501	30.889.267	(382.668.140)	(14.916.000)	(16.882.699)
Zeichnungen	5 13.440.872.865	37.375.695	14.333.684	–	179.326.600	3.518.085.440	281.726.558	468.016.257
Rücknahmen	5 (1.871.240.059)	(19.641.258)	(10.918.339)	(9.555.160)	(66.805.074)	(2.374.832.778)	(550.098.937)	(240.999.370)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	12.105.937.644	44.609.891	22.705.351	–	220.483.316	6.934.454.095	644.439.910	1.444.921.523

	Sustainable Asia High Yield Berichtszeitraum	Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Systematic Global Sustainable Value	Ultra Short Term Euro Bond	Uncorrelated Strategies	US Equity	US Equity Index PutWrite	US Large Cap Value Berichtszeitraum
	zum 31. Dezember 2021**	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	zum 31. Dezember 2021***
Anm.	US\$	US\$	US\$	EUR	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	–	166.292.725	8.270.891	434.001.952	1.769.062.110	6.530.490	204.524.169	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit	(278.723)	(8.927.687)	1.741.717	9.454.661	(56.958.539)	1.465.517	54.653.390	45.700
Zeichnungen	5 25.000.000	29.541.508	13.769.516	1.061.400.276	1.516.796.289	1.991.504	344.835.596	2.000.000
Rücknahmen	5 –	(41.849.121)	(2.893.874)	(344.186.351)	(650.540.648)	(1.055.906)	(128.936.020)	–
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	24.721.277	145.057.425	20.888.250	1.160.670.538	2.578.359.212	8.931.605	475.077.135	2.045.700

\* Der Multi-Style Premia wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

\*\* Der Sustainable Asia High Yield wurde am 13. Dezember 2021 aufgelegt.

\*\*\* Der US Large Cap Value wurde am 20. Dezember 2021 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

		US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$	Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 US\$
	Anm.						
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		398.000.025	611.151.865	352.957.467	589.594.464	96.895.648	31.901.732.445
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		3.683.005	149.928.455	200.584.510	110.705.487	27.103.293	(607.643.730)
Wechselkursbewegung		–	–	–	–	–	(271.028.314)
Zeichnungen	5	230.535.224	317.627.900	1.056.157.567	626.206.928	70.429.401	20.144.499.096
Rücknahmen	5	(158.197.478)	(297.482.549)	(587.402.576)	(504.364.684)	(40.805.916)	(15.733.630.746)
<b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		474.020.776	781.225.671	1.022.296.968	822.142.195	153.622.426	35.433.928.751

\* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

## Aufstellungen der wesentlichen Käufe und Verkäufe (ungeprüft)

In Einklang mit den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011“) (in ihrer geltenden Fassung) wird eine Aufstellung über die Entwicklung der Zusammensetzung des Wertpapierbestands im Berichtszeitraum vorgelegt, um sicherzustellen, dass die Anteilhaber Veränderungen in den vom Portfolio gehaltenen Anlagen identifizieren können. Die folgenden Aufstellungen geben die gesamten Käufe und Verkäufe von Wertpapieren, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, wieder. Es werden mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe aufgeführt, falls zutreffend.

### 5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
13.539.000	Unimicron Technology Corp	87.079.029
1.409.400	StarPower Semiconductor Ltd Class A	72.224.691
7.916.600	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd Class A	64.508.741
1.778.400	SG Micro Corp Class A	62.782.204
185.121	Fortinet Inc	47.976.842
547.109	Micron Technology Inc	47.966.003
3.371.600	Alibaba Group Holding Ltd	43.115.696
898.100	Tencent Holdings Ltd	41.367.259
198.777	Snowflake Inc Class A	39.860.140
7.632.600	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	38.200.048
207.172	Bill.com Holdings Inc	36.251.284
3.401.000	Faraday Technology Corp	34.317.669
3.569.100	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	32.004.309
690.574	Cellnex Telecom SA	30.320.886
322.400	Hoya Corp	29.526.681
816.313	nVent Electric Plc	27.761.397
200.056	T-Mobile US Inc	27.078.379
1.374.600	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	26.721.515
1.708.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	26.262.868
64.925	Monolithic Power Systems Inc	25.696.521
197.900	Lasertec Corp	24.729.836
214.932	Arista Networks Inc	24.216.027
141.421	Universal Display Corp	24.158.811
155.591	Crowdstrike Holdings Inc Class A	23.828.339
617.980	Snap Inc Class A	23.340.339
260.200	Sony Group Corp	22.641.763
119.993	Assurant Inc	22.027.304
147.277	Amazon.com Inc	21.783.765
334.627	II-VI Inc	21.456.947
224.322	Datadog Inc Class A	21.014.052
255.939	Oracle Corp	20.124.890
199.141	Alphabet Inc Class C	19.999.282
76.626	Enphase Energy Inc	19.765.708
241.569	Amdocs Ltd	19.601.145
2.927.500	Koolearn Technology Holding Ltd	18.641.267
274.500	Advantest Corp	18.266.511
293.506	Marvell Technology Inc	16.832.127



## 5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
1.041.000	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	15.893.491
86.390	Dexcom Inc	15.049.137
54.779	Netflix Inc	14.978.628
66.014	Zscaler Inc	14.857.139
485.187	Uber Technologies Inc	14.684.970
94.314	Cadence Design Systems Inc	14.560.636

## 5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
8.083.625	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	76.856.385
4.682.000	Novatek Microelectronics Corp	76.334.246
140.243	Monolithic Power Systems Inc	62.199.320
10.978.000	Unimicron Technology Corp	60.743.110
1.080.398	StarPower Semiconductor Ltd Class A	58.150.792
7.916.600	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd Class A	56.817.454
589.718	SK Hynix Inc	48.020.341
1.373.000	MediaTek Inc	42.818.103
686.100	Advantest Corp	41.951.187
491.700	Sony Group Corp	40.843.095
1.761.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	39.672.005
398.605	Block Inc Class A	38.393.458
269.850	Bill.com Holdings Inc	38.220.669
7.632.600	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	35.284.723
238.228	Universal Display Corp	33.937.067
385.596	Wolfspeed Inc	33.840.862
294.602	Teradyne Inc	33.715.429
274.321	Arista Networks Inc	33.702.460
168.614	Crowdstrike Holdings Inc Class A	33.355.462
197.554	Keysight Technologies Inc	32.568.364
220.586	Fortinet Inc	32.518.942
273.998	Dexcom Inc	32.398.298
260.565	T-Mobile US Inc	32.145.263
898.100	Tencent Holdings Ltd	31.308.126
699.900	SG Micro Corp Class A	30.590.806
784.000	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	29.995.602
629.000	Taiyo Yuden Co Ltd	29.289.189
3.371.600	Alibaba Group Holding Ltd	28.646.776
3.401.000	Faraday Technology Corp	28.102.022
816.313	nVent Electric Plc	27.856.133
106.875	Naver Corp	27.594.706
1.566.900	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	27.110.988
5.019.966	Nokia OYJ ADR	26.729.966
145.604	Zscaler Inc	26.048.078
84.438	ASM International NV	25.292.822
152.035	Analog Devices Inc	25.228.393
579.134	Cellnex Telecom SA	25.036.939
447.846	Micron Technology Inc	24.958.597
168.000	Lasertec Corp	24.178.562
10.579.000	United Microelectronics Corp	23.976.851
560.339	ROBLOX Corp Class A	23.553.242
365.587	Samsung Electronics Co Ltd	23.037.957
224.061	Advanced Micro Devices Inc	22.465.598
220.000	Hoya Corp	22.426.221

## 5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
131.534	Cadence Design Systems Inc	22.163.327
137.366	QUALCOMM Inc	20.411.923
391.242	II-VI Inc	20.228.409
371.039	Ciena Corp	19.938.412
150.537	Masimo Corp	19.806.257
172.031	Synaptics Inc	19.714.633

## Asian Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
625.000	Reliance Industries Ltd, 3.63%, 12/01/2052	601.573
625.000	Reliance Industries Ltd, 2.88%, 12/01/2032	600.468
608.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	463.769
350.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	443.555
450.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	403.025
400.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd, 4.75%, 08/02/2028	401.018
400.000	Bangkok Bank PCL, 4.30%, 15/06/2027	390.812
400.000	Pertamina Persero PT, 6.50%, 27/05/2041	370.560
400.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd, 3.38%, 04/02/2032	370.476
400.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 3.10%, 08/01/2051	311.474
400.000	Sri Lanka Government International Bond, 5.88%, 21/02/2023	291.000
400.000	Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029	274.000
273.000	Lenovo Group Ltd, 5.83%, 27/01/2028	273.000
300.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029	268.500
222.000	SF Holding Investment Ltd, 3.13%, 17/11/2031	217.400
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 5.25%, 24/10/2042	210.750
200.000	China Resources Land Ltd, 6.00%, 27/02/2024	201.188
200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.70%, 06/06/2032	200.000
200.000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd, 5.50%, 06/04/2025	200.000
200.000	Philippine Government International Bond,, 4.20%, 29/03/2047	200.000
200.000	Shriram Finance Ltd, 4.15%, 18/07/2025	200.000
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4.60%, 15/06/2032	200.000
200.000	Shinhan Bank Co Ltd, 4.38%, 13/04/2032	199.616
200.000	Hana Bank, 3.25%, 30/03/2027	199.460
200.000	Indonesia Government International Bond, 3.55%, 31/03/2032	199.166
200.000	ENN Energy Holdings Ltd, 4.63%, 17/05/2027	199.136
200.000	AIA Group Ltd, 5.63%, 25/10/2027	199.080
200.000	SK Telecom Co Ltd, 3.75%, 16/04/2023	199.008
200.000	GC Treasury Center Co Ltd, 4.40%, 30/03/2032	198.818
200.000	China Construction Bank Corp, 4.25%, 27/02/2029	198.122
200.000	Airport Authority, 3.25%, 12/01/2052	198.104
200.000	Woori Bank, 4.75%, 30/04/2024	197.564
200.000	Inventive Global Investments Ltd, 1.50%, 15/07/2023	194.974
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027	193.972
200.000	Lenovo Group Ltd, 3.42%, 02/11/2030	193.390
200.000	BOC Aviation Ltd, 3.50%, 10/10/2024	192.820
200.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd, 4.88%, 17/08/2026	191.250
200.000	Studio City Finance Ltd, 6.00%, 15/07/2025	191.000
200.000	Philippine National Bank, 3.28%, 27/09/2024	190.500
200.000	Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027	190.400
200.000	Korea Gas Corp, 3.88%, 13/07/2027	189.794
200.000	Shriram Finance Ltd, 4.40%, 13/03/2024	189.360
200.000	Horse Gallop Finance Ltd, 1.10%, 26/07/2024	187.350
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd, 3.34%, 05/02/2030	187.338

## Asian Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
200.000	Network i2i Ltd, 5.65%, 29/12/2049	186.000
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.45%, 24/01/2028	184.100
200.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	182.900
200.000	ICBCIL Finance Co Ltd, 2.70%, 27/01/2027	180.771

## Asian Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
625.000	Reliance Industries Ltd, 3.63%, 12/01/2052	562.791
400.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	385.250
375.000	Reliance Industries Ltd, 2.88%, 12/01/2032	373.125
288.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.00%, 29/12/2049	286.560
250.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	279.665
250.000	MCC Holding Hong Kong Corp Ltd, 3.25%, 29/12/2049	254.375
300.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029	235.500
200.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 4.25%, 12/09/2028	218.374
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd, 5.88%, 29/12/2049	210.000
200.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd, 4.00%, 29/12/2049	207.250
200.000	FWD Group Ltd, 5.75%, 09/07/2024	206.520
200.000	Pertamina Persero PT, 6.50%, 27/05/2041	206.260
200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.70%, 06/06/2032	205.750
200.000	Sands China Ltd, 5.90%, 08/08/2028	205.624
200.000	China Resources Land Ltd., 4.13%, 26/02/2029	204.600
200.000	Shriram Finance Ltd, 4.40%, 13/03/2024	203.300
200.000	Indonesia Government International Bond, 3.55%, 31/03/2032	202.750
200.000	Bangkok Bank PCL, 4.30%, 15/06/2027	201.200
200.000	ENN Energy Holdings Ltd, 4.63%, 17/05/2027	200.480
200.000	Philippine Government International Bond, 4.20%, 29/03/2047	199.800
200.000	Axis Bank Ltd, 4.10%, 29/12/2049	199.540
200.000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd, 5.50%, 06/04/2025	198.540
200.000	HPHT Finance 21 Ltd, 2.00%, 19/03/2026	198.294
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd, 4.75%, 08/02/2028	197.608
200.000	SF Holding Investment 2021 Ltd, 3.13%, 17/11/2031	196.445
200.000	Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd, 4.95%, 12/08/2024	194.100
200.000	Bangkok Bank PCL, 3.73%, 25/09/2034	193.102
200.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 3.20%, 24/03/2171	191.900
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.45%, 24/01/2028	189.600
200.000	Zhejiang Seaport International Co Ltd, 1.98%, 17/03/2026	187.104
200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd, 3.38%, 04/02/2032	185.882
200.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd, 3.13%, 16/07/2025	184.666
200.000	SK Battery America Inc, 2.13%, 26/01/2026	184.500
200.000	Ca Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026	181.000
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4.88%, 17/07/2049	176.010
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd, 5.95%, 20/10/2025	175.176
200.000	Meituan, 3.05%, 28/10/2030	170.792
200.000	CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	160.000
200.000	Sri Lanka Government International Bond, 5.88%, 25/07/2022	155.750
100.000	Indonesia Government International Bond, 7.75%, 17/01/2038	124.020
200.000	SriLankan Airlines Ltd, 7.00%, 25/06/2024	110.000
200.000	Logan Group Co Ltd, 5.25%, 23/02/2023	105.000

## China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten CNY
4.300	Luoyang Xinqianglian Slewing Bearing Co Ltd Class A	501.566
5.300	Alibaba Group Holding Ltd	470.380
12.300	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	453.350
7.600	Tongwei Co Ltd Class A	410.092
14.200	Ming Yang Smart Energy Group Ltd Class A	394.539
11.400	China Yangtze Power Co Ltd Class A	266.620
3.900	Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd Class A	262.567
9.200	Sinoma Science & Technology Co Ltd Class A	252.083
5.500	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A	247.107
2.300	Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A	243.266
1.200	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	196.545
36.300	Postal Savings Bank of China Co Ltd Class A	193.541
3.700	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	173.273
5.300	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	169.144
4.300	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	129.960
600	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	117.072
2.000	Midea Group Co Ltd Class A	115.684
1.800	Guangdong Haid Group Co Ltd Class A	113.150
300	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	112.427
2.000	Wingtech Technology Co Ltd Class A	111.679
900	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	108.066
9.200	Shenzhen Topband Co Ltd Class A	101.551
9.000	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A	95.012
700	Meituan Class B	91.001
1.400	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	82.513
5.854	China Jushi Co Ltd Class A	80.029
700	Chongqing Brewery Co Ltd Class A	77.896
1.416	Montage Technology Co Ltd Class A	77.244
2.700	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A	74.617
17.900	TCL Technology Group Corp Class A	73.569
3.200	Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A	71.008
3.900	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	64.253

## China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse CNY
9.500	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	703.956
4.980	Luoyang Xinqianglian Slewing Bearing Co Ltd Class A	477.421
10.900	China Merchants Bank Co Ltd Class A	417.747
20.600	China Vanke Co Ltd Class A	361.652
11.300	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	350.048
2.000	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	288.361
10.900	Riyue Heavy Industry Co Ltd Class A	276.722
6.200	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A	269.364
13.600	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A	256.154
4.800	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	255.407
1.100	Tencent Holdings Ltd	250.047
13.300	Weichai Power Co Ltd Class A	233.948
6.300	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class A	225.804
16.910	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A	218.517
500	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	217.290
1.000	Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A	204.852
1.500	Meituan Class B	198.408
3.100	Guangdong Haid Group Co Ltd Class A	178.358
2.501	Montage Technology Co Ltd Class A	175.304
2.900	Alibaba Group Holding Ltd	172.244
1.000	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	171.740
10.500	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	167.136
500	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A	165.975
36.300	Postal Savings Bank of China Co Ltd Class A	165.891
100	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	163.689
17.100	Gemdale Corp Class A	161.215
1.800	Tsingtao Brewery Co Ltd Class A	150.433
292	Beijing Roborock Technology Co Ltd Class A	149.954
5.800	NARI Technology Co Ltd Class A	144.051
900	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	142.952
2.700	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	142.662
3.300	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	95.035
1.300	Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A	90.903
1.200	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	90.507



## China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten CNY
30.000.000	Bank of China Ltd, 4.84%, 11/10/2028	30.417.000
30.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 9.46%, 22/02/2023	29.799.646
30.000.000	Bank of China Ltd, 2.59%, 08/03/2023	29.264.280
30.000.000	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd, 2.44%, 14/02/2023	29.260.050
30.000.000	China Construction Bank Corp, 3.04%, 11/04/2022	29.152.920
20.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 3.50%, 14/04/2032	20.221.500
20.000.000	Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd, 3.00%, 21/04/2025	19.988.600
20.000.000	Bank of China Ltd, 3.02%, 26/10/2032	19.976.940
20.000.000	China Government Bond, 2.18%, 25/08/2025	19.877.900
20.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 0.00%, 05/06/2023	19.785.869
20.000.000	China Construction Bank Corp, 0.00%, 03/08/2023	19.620.780
20.000.000	China Citic Bank Corp, 0.00%, 22/09/2023	19.609.620
20.000.000	China Everbright Bank Co Ltd, 0.00%, 28/02/2023	19.556.420
20.000.000	Agricultural Bank of China, 3.04%, 14/04/2022	19.439.440
18.000.000	China Post Group Co Ltd, 2.84%, 20/01/2025	17.882.280
2.000.000	BOC Aviation USA Corp, 1.63%, 29/04/2024	13.341.049
2.000.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd, 1.00%, 23/09/2024	12.948.625
12.900.000	Nanshan Group Co Ltd, 5.85%, 23/09/2024	12.909.480
2.000.000	Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd, 1.51%, 17/09/2025	12.796.181
1.900.000	Haitong International Securities Group Ltd, 3.38%, 19/07/2024	12.618.442
1.870.000	China Hongqiao Group Ltd, 7.38%, 02/05/2023	12.293.877
2.200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd, 4.45%, 17/08/2026	10.620.909
10.000.000	Agricultural Bank of China Ltd, 4.30%, 11/04/2029	10.142.010
1.930.000	Logan Group Co Ltd, 6.50%, 16/07/2023	10.110.173
10.000.000	China Government Bond, 2.47%, 02/09/2024	10.021.930
10.000.000	Tianfeng Securities Co Ltd, 3.25%, 24/11/2022	9.996.500
10.000.000	Tianfeng Securities Co Ltd, 3.15%, 14/12/2022	9.995.300
10.000.000	China Resources Inc, 2.90%, 22/04/2025	9.983.040
10.000.000	Shanghai Fosun High Technology Group Co Ltd, 4.79%, 25/10/2022	9.981.070
10.000.000	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd, 3.80%, 27/08/2023	9.967.200
10.000.000	Bank of China Ltd, 2.48%, 21/02/2023	9.746.380
8.000.000	Tianfeng Securities Co Ltd, 4.30%, 27/12/2024	8.085.360
8.000.000	GF Securities Co Ltd, 3.30%, 29/10/2024	8.054.000
8.000.000	Haitong Securities Co Ltd, 3.10%, 10/11/2024	8.024.960
8.000.000	China Southern Power, 3.72%, 17/05/2022	8.019.600
8.000.000	China Merchants Securities Co Ltd, 2.89%, 17/01/2025	7.958.320
1.000.000	SF Holding Investment Ltd, 4.13%, 26/07/2023	7.195.236
1.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd, 4.25%, 07/08/2023	7.063.713
1.000.000	Prosperous Ray Ltd, 4.63%, 12/11/2023	7.050.358
1.000.000	Kunlun Energy Co Ltd, 3.75%, 13/05/2025	6.980.713
1.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd, 3.00%, 18/07/2024	6.941.551
1.000.000	China Construction Bank Corp, 1.00%, 04/08/2023	6.931.673
1.000.000	Coastal Emerald Ltd, 3.95%, 01/08/2022	6.696.380
1.000.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd, 1.50%, 13/07/2025	6.643.135
1.000.000	BOC Aviation Ltd, 3.25%, 29/04/2025	6.623.434

## China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse CNY
50.000.000	China Government Bond, 3.02%, 27/05/2031	50.974.200
30.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 0.00%, 22/02/2023	29.853.909
30.000.000	Bank of China, 0.00%, 08/03/2023	29.361.240
30.000.000	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd, 2.90%, 25/01/2022	29.154.510
30.000.000	China Construction Bank Corp, 3.04%, 11/04/2022	29.114.910
24.000.000	Shandong Weiqiao Aluminum & Power Co Ltd, 4.80%, 17/10/2023	24.274.050
20.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 3.50%, 14/04/2032	20.410.040
20.000.000	Central Huijin Investment Ltd, 2.92%, 19/06/2023	20.152.700
20.000.000	Guotai Junan Securities Co Ltd, 3.48%, 21/07/2026	20.148.400
20.000.000	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	20.125.600
20.000.000	Shenwan Hongyuan Securities Co Ltd, 3.38%, 28/07/2026	20.084.820
20.000.000	Bank of China, 3.02%, 26/10/2032	19.730.060
20.000.000	China Construction Bank Corp, 0.00%, 03/08/2023	19.609.680
20.000.000	Agricultural Bank of China, 3.04%, 14/04/2022	19.409.940
17.000.000	China Government Bond, 3.72%, 12/04/2051	18.105.997
17.000.000	Everbright Securities Co Ltd, 3.45%, 16/07/2026	17.238.060
17.000.000	Shenzhen Investment Holdings Co Ltd, 3.38%, 02/08/2026	17.216.221
10.000.000	Giant Leap, 4.28%, 15/09/2024	9.949.200
10.000.000	Bank of China, 2.48%, 21/02/2023	9.768.770
10.000.000	Agricultural Bank of China, 3.14%, 08/03/2022	9.695.560
10.000.000	Shanghai Fosun High Technology Group Co Ltd, 4.79%, 25/10/2022	8.990.000
19.447.000	Shanghai Shimao Jianshe Co Ltd, 4.15%, 16/10/2022	8.367.940
8.000.000	GF Securities Co Ltd, 3.30%, 29/10/2024	8.144.848
8.000.000	Haitong Securities Co Ltd, 3.10%, 10/11/2024	8.087.280
8.000.000	China Merchants Securities Co Ltd, 2.89%, 17/01/2025	8.054.000
8.000.000	China Post Group Co Ltd, 2.84%, 20/01/2025	8.034.800
8.000.000	Tianfeng Securities Co Ltd, 4.30%, 27/12/2024	7.784.560
8.000.000	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd, 0.00%, 20/02/2025	7.347.190
1.000.000	BOC Aviation Ltd, 3.25%, 29/04/2025	6.723.451
1.600.000	Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd, 4.95%, 12/08/2024	6.590.811
1.930.000	Logan Group Co Ltd, 6.50%, 16/07/2023	6.572.778
1.000.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd, 1.00%, 23/09/2024	6.538.896

## China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
532.631	ZTO Express Cayman Inc ADR	13.353.600
2.258.109	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	12.670.874
445.150	JD.com Inc Class A	10.847.889
1.100.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	7.745.706
366.014	Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A	7.368.123
1.660.058	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A	6.945.641
450.077	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	6.205.094
592.027	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	5.339.970
168.700	Tencent Holdings Ltd	4.995.175
174.003	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	4.781.388
218.000	Meituan Class B	4.651.929
1.085.035	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	4.343.669
1.477.451	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A	4.292.328
340.000	Shenzhen International Group Holdings Ltd	4.260.421
600.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	3.331.388
393.000	Li Ning Co Ltd	3.094.733
718.000	SITC International Holdings Co Ltd	2.708.941
2.000.000	China National Building Material Co Ltd - H Shares	2.594.678
199.700	Alibaba Group Holding Ltd	2.358.581
22.641	ACM Research Inc Class A	1.822.815
678.000	Akeso Inc Class B	1.664.967
195.500	Midea Group Co Ltd Class A	1.630.425
1.500.000	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	1.629.481
350.000	JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A	1.601.119
175.000	Ninestar Corp Class A	1.349.617

## China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
15.000.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	17.126.520
5.717.000	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A	15.999.627
10.302.000	China National Building Material Co Ltd – H Shares	12.476.710
3.401.000	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares	11.436.170
365.388	JD.com Inc Class A	10.352.775
262.900	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	9.391.634
1.509.500	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	9.255.088
699.700	Alibaba Group Holding Ltd	8.931.702
9.499.900	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	8.358.247
1.812.000	China Resources Land Ltd	7.968.141
1.100.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	7.313.694
534.000	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	6.705.552
390.954	ACM Research Inc Class A	6.447.622
2.421.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	6.188.733
143.700	Tencent Holdings Ltd	6.068.396
185.790	Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A	5.951.582
8.922.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	5.902.735
789.500	Midea Group Co Ltd Class A	5.703.460
660.394	Full Truck Alliance Co Ltd ADR	5.115.248
934.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	4.650.461
654.000	JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A	4.164.936
3.000.000	Oriental Energy Co Ltd Class A	3.868.272
340.000	Shenzhou International Group Holdings Ltd	3.482.766
1.033.500	Satellite Chemical Co Ltd Class A	2.890.697
145.000	Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A	2.373.868
128.400	Cansino Biologics Inc – H Shares	2.142.357
549.000	Akeso Inc Class B	2.054.340

## CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
5.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 6 Ltd Series 2019-6X Class ER, 6.72%, 20/04/2035	5.000.000
4.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 14 Ltd Series 2022-14X Class E, 12.37%, 20/07/2035	4.205.124
3.000.000	Invesco CLO 2022-1 Ltd Series 2022-1X Class D, 7.69%, 20/04/2035	2.804.730
2.800.000	AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E, 12.64%, 20/10/2035	2.716.000
2.400.000	Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F, 11.41%, 15/04/2035	2.609.165
2.000.000	AB BSL CLO 1 Ltd Series 2020-1X Class ER, 11.49%, 15/01/2035	1.980.000
1.675.000	Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class ER, 11.15%, 15/01/2035	1.658.250
1.500.000	CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class F, 10.90%, 25/04/2036	1.547.839
1.600.000	Providus CLO IV DAC Series 4X Class ER, 7.45%, 20/04/2034	1.411.482
1.150.000	Otranto Park CLO DAC Series 1X Class F, 10.85%, 15/05/2035	1.180.398
1.000.000	Trinitas CLO XVII Ltd Series 2021-17X Class E, 11.84%, 20/10/2034	983.220

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
5.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 6 Ltd Series 2019-6X Class E, 5.35%, 20/01/2033	5.000.000
5.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 6 Ltd Series 2019-6X Class ER, 6.72%, 20/04/2035	4.300.000
4.750.000	Palmer Square CLO 2018-2 Ltd Series 2018-2X Class D, 5.72%, 16/07/2031	4.147.225
2.017.081	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd Series 2018-4X Class D, 4.41%, 15/11/2026	2.017.081
2.000.000	AGL CLO 14 Ltd Series 2021-14X Class E, 6.77%, 02/12/2034	1.762.200
2.000.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class E, 11.76%, 25/04/2033	1.723.600
1.675.000	Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class E, 7.02%, 15/04/2032	1.675.000
1.700.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class ER, 6.06%, 15/05/2030	1.533.757
1.500.000	TICP CLO XI Ltd Series 2018-11X Class E, 6.13%, 20/10/2031	1.288.200
1.500.000	Symphony CLO XXV Ltd Series 2021-25X Class E, 10.73%, 19/04/2034	1.271.550
1.000.000	RR 12 Ltd Series 2020-12X Class DR2, 6.84%, 15/01/2036	901.300
1.000.000	Invesco CLO Ltd Series 2021-1X Class E, 6.63%, 15/04/2034	879.110
500.000	Palmer Square CLO 2020-3 Ltd Series 2020-3X Class D, 8.04%, 15/11/2031	500.000

## Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
15.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/12/2022	14.891.520
15.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/06/2023	14.660.097
10.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/03/2023	9.903.985
7.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/10/2022	7.267.213
7.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/10/2022	7.258.513
7.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/02/2023	7.209.479
7.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/02/2023	7.201.122
6.725.000	Federal Home Loan Mortgage Corp, 0.25%, 24/08/2023	6.486.733
5.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 03/05/2022	5.748.075
5.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/05/2022	5.747.413
5.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/05/2022	5.746.375
5.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/06/2022	5.745.563
5.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/06/2022	5.295.271
5.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/06/2022	5.295.170
5.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/09/2022	5.283.537
5.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 15/09/2022	5.282.285
5.000.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 1.85%, 05/08/2022	5.018.950
5.000.000	Federal National Mortgage Association, 1.38%, 06/09/2022	5.010.752
4.250.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/09/2022	4.238.286
4.125.000	Federal Home Loan Banks, 0.13%, 28/08/2023	3.972.499
2.500.000	Federal Home Loan Banks, 3.00%, 09/12/2022	2.530.382
1.885.000	Wells Fargo & Co, 3.75%, 24/01/2024	1.854.702

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
5.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 03/05/2022	5.748.957
5.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/05/2022	5.748.578
5.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/05/2022	5.747.707
500.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/06/2022	499.755
90.000	American Express Co, 2.20%, 27/02/2023	90.289

## Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
50.200.000	Solvay SA, 2.50%, 29/12/2049	44.085.605
42.700.000	Evonik Industries AG, 1.38%, 02/09/2081	36.668.000
33.405.000	SSE Plc, 4.00%, 29/12/2049	33.405.000
33.600.000	ELM BV for Firmenich International SA, 3.75%, 29/12/2049	32.254.749
40.600.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081	31.042.250
30.000.000	Electricite de France SA, 7.50%, 06/12/2171	30.000.000
28.200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2.38%, 29/12/2049	28.083.252
30.955.000	Rogers Communications Inc, 5.25%, 15/03/2082	27.111.890
20.648.000	SSE Plc, 3.74%, 29/12/2049	24.608.185
27.300.000	EDP - Energias de Portugal SA, 1.88%, 14/03/2082	23.757.675
24.900.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.13%, 05/11/2079	22.371.000
24.500.000	Paramount Global, 6.38%, 30/03/2062	22.257.552
18.900.000	Veolia Environnement SA, 2.50%, 29/12/2049	18.221.310
17.700.000	Orsted A/S, 5.25%, 08/12/3022	17.700.000
20.000.000	Iberdrola International BV, 1.45%, 09/02/2171	17.275.000
18.378.000	Southern Co, 1.88%, 15/09/2081	16.527.145
16.800.000	Elia Group SA, 2.75%, 29/12/2049	16.186.500
17.500.000	Aroundtown SA, 2.88%, 29/12/2049	15.282.250
15.000.000	Volkswagen International Finance NV, 4.38%, 29/12/2049	14.996.000
15.000.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.88%, 29/06/2080	13.363.750
10.768.000	BP Capital Markets Plc, 4.25%, 29/12/2049	13.015.192
13.705.000	TotalEnergies SE, 1.75%, 29/12/2049	12.977.756
12.900.000	Telefonica Europe BV, 7.13%, 23/11/2171	12.900.000
13.000.000	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.50%, 23/04/2075	12.814.380
11.300.000	Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049	12.034.500
9.600.000	Electricite de France SA, 6.00%, 29/12/2049	11.958.859
10.800.000	Volkswagen International Finance NV, 4.63%, 29/12/2049	11.955.600
13.559.000	Enbridge Inc, 5.50%, 15/07/2077	11.917.702
11.744.000	TotalEnergies SE, 1.63%, 29/12/2049	10.936.600
10.000.000	SES SA, 5.63%, 29/12/2049	10.790.000
12.018.000	CMS Energy Corp, 3.75%, 01/12/2050	9.660.339
8.700.000	Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049	9.448.573
10.000.000	AT Securities BV, 5.25%, 29/12/2049	9.195.809
9.800.000	Veolia Environnement SA, 2.00%, 29/12/2049	9.094.400
8.100.000	Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049	7.965.740
7.600.000	Bayer AG, 5.38%, 25/03/2082	7.478.400

## Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
110.789.000	Enel SpA, 8.75%, 24/09/2073	108.485.691
69.100.000	TenneT Holding BV, 2.37%, 29/12/2049	65.939.476
61.437.000	CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	55.487.020
68.800.000	Veolia Environnement SA, 2.50%, 29/12/2049	53.243.375
56.771.000	SES SA, 2.88%, 29/12/2049	47.645.123
43.886.000	Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078	41.305.928
38.200.000	Volkswagen International Finance NV, 3.38%, 29/12/2049	38.576.054
38.400.000	Bayer AG, 2.38%, 12/11/2079	35.631.195
35.630.000	SES SA, 5.63%, 29/12/2049	34.592.700
31.900.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.13%, 05/11/2079	29.403.785
28.090.000	Eni SpA, 2.00%, 29/12/2049	27.282.652
27.646.000	Volkswagen International Finance NV, 4.63%, 29/12/2049	26.832.364
23.700.000	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.00%, 23/04/2075	23.930.150
24.300.000	Veolia Environnement SA, 2.25%, 29/12/2049	23.130.517
29.314.000	American Electric Power Co Inc, 3.88%, 15/02/2062	21.567.312
20.146.000	TotalEnergies SE, 2.71%, 29/12/2049	20.440.262
17.213.000	NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073	19.811.349
21.940.000	SSE Plc, 4.75%, 16/09/2077	19.648.339
17.169.000	Holcim Finance Luxembourg SA, 3.00%, 29/12/2049	17.147.539
16.600.000	Engie SA, 1.63%, 29/12/2049	15.953.386
16.000.000	AT Securities BV, 5.25%, 29/12/2049	14.522.857
14.200.000	Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049	14.355.550
18.000.000	Volkswagen International Finance NV, 3.50%, 29/12/2049	14.222.500
12.900.000	Telefonica Europe BV, 7.13%, 23/11/2171	13.089.950
12.391.000	Eni SpA, 3.38%, 29/12/2049	11.935.551
10.000.000	SSE Plc, 3.74%, 29/12/2049	11.024.375
10.185.000	Bayer AG, 3.75%, 01/07/2074	10.533.836
10.000.000	Solvay Finance SACA, 5.87%, 29/12/2049	10.384.306
9.500.000	Arkema SA, 2.75%, 29/12/2049	9.878.775



## Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
26.696.000	Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034	26.439.329
111.750.000	Argentine Republic Government International Bond, 1.50%, 09/07/2035	25.480.575
19.450.000	Republic of South Africa Government International Bond, 7.30%, 20/04/2052	18.267.201
17.427.000	Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033	16.799.300
21.010.000	Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029	16.000.958
18.770.000	Petroleos Mexicanos, 7.69%, 23/01/2050	15.451.795
15.411.000	Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035	15.308.200
17.469.000	Ivory Coast Government International Bond, 5.25%, 22/03/2030	14.841.925
14.387.000	Angolan Government International Bond, 8.75%, 14/04/2032	13.885.545
15.940.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	13.820.651
16.310.000	Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047	13.385.409
12.217.000	Reliance Industries Ltd, 2.88%, 12/01/2032	12.044.975
10.000.000	Croatia Government International Bond, 2.75%, 27/01/2030	11.658.126
9.300.000	Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036	9.662.040
11.700.000	Bahamas Government International Bond, 6.00%, 21/11/2028	9.296.303
9.411.000	Reliance Industries Ltd, 3.63%, 12/01/2052	9.280.375
10.780.000	Angolan Government International Bond, 9.38%, 08/05/2048	9.216.381
14.750.000	Ecuador Government International Bond, 2.50%, 31/07/2035	9.106.269
9.149.000	Comision Federal de Electricidad, 4.69%, 15/05/2029	9.089.770
10.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	9.060.000
9.080.000	Mexico Government International Bond, 3.50%, 12/02/2034	9.030.605
8.375.000	Croatia Government International Bond, 2.88%, 22/04/2032	9.007.197
8.401.000	Mexico Government International Bond, 2.38%, 11/02/2030	8.934.139
10.380.000	Egypt Government International Bond, 8.70%, 01/03/2049	8.848.950
13.770.000	Arab Republic of Egypt, 8.88%, 29/05/2050	8.775.938
11.940.000	Republic of Kenya Government International Bond, 8.00%, 22/05/2032	8.541.940
7.310.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 6.15%, 21/05/2048	8.147.183
7.860.000	Guatemala Government Bond, 5.38%, 24/04/2032	8.050.433
7.962.000	Colombia Government International Bond, 8.00%, 20/04/2033	7.956.703
10.872.632	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd, 0.00%, 5/06/2034	7.257.482
6.770.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 5.25%, 15/05/2047	7.100.038
7.122.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.75%, 16/11/2032	7.047.433
8.660.000	Petroleos Mexicanos, 6.95%, 28/01/2060	6.793.178
6.658.000	Bermuda Government International Bond, 5.00%, 15/07/2032	6.777.096

## Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
32.476.000	Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042	36.607.783
25.367.000	Croatia Government International Bond, 2.75%, 27/01/2030	25.943.529
26.428.000	Petroleos Mexicanos, 5.95%, 28/01/2031	24.276.045
25.582.000	Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045	22.988.263
67.604.545	Argentine Republic Government International Bond, 3.88%, 09/01/2038	20.993.933
18.258.000	Costa Rica Government International Bond, 6.13%, 19/02/2031	18.139.890
61.267.149	Argentine Republic Government International Bond, 3.50%, 09/07/2041	16.744.443
16.150.000	Angolan Government International Bond, 8.25%, 09/05/2028	16.033.440
16.638.000	Petroleos Mexicanos, 5.35%, 12/02/2028	15.837.148
14.989.000	Turkey Government International Bond, 7.25%, 23/12/2023	15.568.968
10.800.000	Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033	14.927.721
14.507.000	Turkey Government International Bond, 5.60%, 14/11/2024	13.919.368
18.456.000	Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045	13.559.601
15.610.000	Nigeria Government International Bond, 7.88%, 16/02/2032	12.276.801
10.870.000	Bermuda Government International Bond, 4.75%, 15/02/2029	12.079.933
14.213.000	Serbia International Bond, 2.13%, 01/12/2030	11.417.918
10.400.000	Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 24/03/2026	11.260.770
11.920.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	10.637.466
17.400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond, 5.10%, 28/03/2035	9.976.600
9.655.000	Paraguay Government International Bond, 4.95%, 28/04/2031	9.819.715
10.479.000	Nigeria Government International Bond, 7.38%, 28/09/2033	9.815.964
9.084.000	Mongolia Government International Bond, 8.75%, 09/03/2024	9.787.275
10.240.000	Turkey Government International Bond, 6.38%, 14/10/2025	9.772.475
11.650.000	Croatia Government International Bond, 1.13%, 04/03/2033	9.458.466
8.906.000	Croatia Government International Bond, 1.50%, 17/06/2031	9.306.533
10.826.000	Egypt Government International Bond, 7.30%, 30/09/2033	8.985.035
8.820.000	China Minmetals Corp, 3.75%, 29/12/2049	8.967.350
8.906.000	Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049	8.808.900

## Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
93.293.300	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/07/2022	93.095.323
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/10/2022	89.516.790
1.565.295.200	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	72.038.408
824.230.192	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	56.023.863
261.572.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	49.800.684
880.158.506	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	45.450.140
235.290.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	43.390.640
870.022.003	Mexican Udibonos, 3.50%, 16/11/2023	42.671.271
35.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/08/2022	34.894.673
1.228.000.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	34.200.348
435.459.902	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	22.506.024
474.946.872	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	22.180.142
130.970.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	21.434.458
540.470.000	Czech Republic Government Bond, 1.00%, 26/06/2026	21.007.998
20.918.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/04/2022	20.913.156
68.808.267	Bank of Israel Bill – Makam, 0.00%, 02/11/2022	20.424.267
65.500.000	Bank of Israel Bill – Makam, 0.00%, 04/05/2022	20.407.680
219.902.717	Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025	20.364.498
126.410.000	Romania Government Bond, 2.50%, 25/10/2027	20.168.641
310.200.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.13%, 15/04/2027	20.149.958
297.800.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/04/2032	19.374.605
303.600.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028	19.133.015
364.520.800	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	18.138.154
1.400.000.000	India Government Bond, 7.38%, 20/06/2027	17.940.518
9.132.140.000	Hungary Government Bond, 3.00%, 27/10/2027	17.868.618
3.586.334.300	Mexico Cetes, 0.00%, 28/07/2022	17.318.051
307.919.612	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	15.369.362
303.289.507	Mexican Udibonos, 4.00%, 30/11/2028	14.819.743
65.500.000	Malaysia Government Bond, 3.90%, 16/11/2027	14.350.011
67.043.000	Republic of Poland Government Bond, 3.25%, 25/07/2025	14.066.235
262.391.803	Republic of South Africa Government Bond, 9.00%, 31/01/2040	13.866.231

## Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/10/2022	89.885.937
62.727.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/04/2022	62.707.833
915.673.140	Mexican Udibonos, 3.50%, 16/11/2023	46.276.987
3.200.000.000	India Government Bond, 7.32%, 28/01/2024	43.705.575
215.592.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	39.848.133
540.250.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/04/2032	35.050.442
7.392.440.000	Russian Federal Bond - OFZ, 4.50%, 16/07/2025	31.785.152
140.245.400.000	Colombian TES, 7.00%, 26/03/2031	31.162.747
461.685.887	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	31.053.950
1.040.621.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	29.768.107
598.223.400	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	29.157.777
561.260.000	Mexican Bonos, 10.00%, 05/12/2024	28.620.327
14.866.220.000	Hungary Government Bond, 3.00%, 27/10/2027	27.968.821
183.000.000	China Government Bond, 1.99%, 09/04/2025	27.329.323
133.058.000	Republic of Poland Government Bond, 0.25%, 25/10/2026	24.443.997
465.702.723	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	24.370.993
300.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 8.13%, 15/05/2024	22.613.134
454.291.600	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	21.252.164
417.679.579	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	19.200.032
310.200.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.13%, 15/04/2027	19.156.049
420.939.800	Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027	18.928.763
92.264.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	18.227.697
422.942.600	Mexican Bonos, 7.75%, 13/11/2042	18.036.305
3.586.334.300	Mexico Cetes, 0.00%, 28/07/2022	17.794.794
1.400.000.000	India Government Bond, 7.38%, 20/06/2027	17.146.149
313.524.429	Republic of South Africa Government Bond, 9.00%, 31/01/2040	16.091.809
304.941.639	Mexican Udibonos, 4.00%, 30/11/2028	15.642.721
508.000.000	Thailand Government Bond, 2.13%, 17/12/2026	15.588.243
88.500.000	China Government Bond, 3.72%, 12/04/2051	14.650.528
94.500.000	China Government Bond, 3.13%, 21/11/2029	14.453.424

## Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
319.089.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	14.794.862
12.493.500	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/07/2022	12.467.082
198.164.468	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	10.732.573
155.913.175	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	10.679.350
207.574.696	Mexican Udibonos, 3.50%, 16/11/2023	10.183.863
49.456.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	9.438.342
44.466.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	8.181.706
8.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/08/2022	7.975.925
235.000.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	6.566.006
129.310.000	Czech Republic Government Bond, 1.00%, 26/06/2026	5.026.263
31.100.000	China Government Bond, 2.89%, 18/11/2031	4.957.739
15.636.512	Bank of Israel Bill - Makam, 0.00%, 02/11/2022	4.644.269
28.049.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	4.603.190
48.324.722	Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025	4.485.586
65.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.13%, 15/04/2027	4.262.916
84.692.400	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	4.220.452
2.001.050.000	Hungary Government Bond, 3.00%, 27/10/2027	3.962.716
300.000.000	India Government Bond, 7.38%, 20/06/2027	3.844.397
59.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028	3.717.847
68.635.106	Mexican Udibonos, 4.00%, 30/11/2028	3.360.538
72.402.163	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	3.321.178
15.811.000	Republic of Poland Government Bond, 3.25%, 25/07/2025	3.317.293
20.775.000	Romania Government Bond, 2.50%, 25/10/2027	3.299.382
60.891.232	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	3.112.354

## Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
12.493.500	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/07/2022	12.476.190
900.000.000	India Government Bond, 7.32%, 28/01/2024	12.300.670
216.995.123	Mexican Udibonos, 3.50%, 16/11/2023	10.910.203
221.014.400	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	10.108.551
52.287.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	9.765.657
174.174.116	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	9.394.446
59.200.000	China Government Bond, 2.36%, 02/07/2023	8.786.480
129.485.320	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	8.476.143
8.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/08/2022	7.992.183
122.900.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/04/2032	7.957.863
34.425.400.000	Colombian TES, 7.00%, 26/03/2031	7.654.179
42.004.000	Republic of Poland Government Bond, 0.25%, 25/10/2026	7.462.981
192.520.000	Czech Republic Government Bond, 2.40%, 17/09/2025	7.326.843
6.440.000	Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 24/03/2026	6.762.177
44.770.000	China Government Bond, 2.85%, 04/06/2027	6.706.371
129.740.000	Mexican Bonos, 10.00%, 05/12/2024	6.618.321
128.132.400	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	6.131.690
133.990.000	Mexican Bonos, 7.75%, 13/11/2042	5.906.697
28.639.800.000	Colombian TES, 5.75%, 03/11/2027	5.772.537
165.200.000	Thailand Government Bond, 3.65%, 20/06/2031	5.601.981

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
2.050.000	Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036	2.236.860
1.650.000	Chile Government International Bond, 0.83%, 02/07/2031	1.394.379
930.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	1.258.750
1.300.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	1.094.478
1.160.000	Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034	995.458
650.000	Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033	861.260
2.621.204	Bank of Israel Bill – Makam, 0.00%, 02/11/2022	776.351
16.595.900	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	773.473
720.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	706.954
12.555.300	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	629.509
600.000	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.15%, 14/01/2030	599.940
550.000	Hungary Government International Bond, 1.63%, 28/04/2032	584.113
480.000	UAE International Government Bond, 4.95%, 07/07/2052	503.380
510.000	Chile Government International Bond, 1.88%, 27/05/2030	469.504
588.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	461.449
2.330.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	432.043
400.000	Bulgaria Government International Bond, 4.13%, 23/09/2029	409.188
400.000	Bermuda Government International Bond, 5.00%, 15/07/2032	408.022
300.000	Uruguay Government International Bond, 7.88%, 15/01/2033	402.547
400.000	Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035	401.192
2.067.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	392.374
400.000	Panama Government International Bond, 3.88%, 17/03/2028	391.048
5.600.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/04/2032	356.807
450.000	Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033	355.578
400.000	Banque Ouest Africaine de Developpement, 4.70%, 22/10/2031	343.880
5.100.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.13%, 15/04/2027	340.152

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.400.000	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.15%, 14/01/2030	1.310.540
400.000	Qatar Government International Bond, 6.40%, 20/01/2040	504.500
400.000	Panama Government International Bond, 9.38%, 01/04/2029	465.000
511.000	Croatia Government International Bond, 1.13%, 19/06/2029	446.968
400.000	Qatar Government International Bond, 5.10%, 23/04/2048	443.692
400.000	Qatar Government International Bond, 4.00%, 14/03/2029	416.352
400.000	Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042	399.252
400.000	Panama Government International Bond, 3.88%, 17/03/2028	393.100
47.910.000	Russian Federal Bond - OFZ, 4.50%, 16/07/2025	386.393
1.266.372	Bank of Israel Bill - Makam, 0.00%, 02/11/2022	385.313
400.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 1.99%, 21/07/2025	371.932
400.000	Panama Government International Bond, 3.16%, 23/01/2030	370.284
7.286.797	Mexican Udibonos Series S, 3.50%, 16/11/2023	367.946
6.840.000	Mexican Bonos, 10.00%, 05/12/2024	351.554
1.782.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	328.837
300.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	310.500
303.000	Hungary Government Bond, 5.50%, 16/06/2034	289.365
267.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/10/2022	265.863
3.500.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.50%, 15/06/2025	255.779
8.000.000	Thailand Government Bond, 0.95%, 17/06/2025	235.166
8.150.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	235.094
1.500.000	China Government Bond, 3.02%, 22/10/2025	231.708
200.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	225.263
122.440.000	Hungary Government Bond, 3.00%, 27/10/2027	224.671
4.990.000	Mexican Bonos, 7.75%, 13/11/2042	220.962
225.000	Hungary Government International Bond, 5.25%, 16/06/2029	219.938
3.300.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/04/2032	215.625
200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.70%, 06/06/2032	208.752
200.000	Qatar Government International Bond, 4.40%, 16/04/2050	203.028
200.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC, 2.50%, 06/05/2031	194.250
200.000	Sharjah Sukuk Program Ltd, 3.85%, 03/04/2026	190.000
200.000	China Development Bank Financial Leasing Co Ltd, 2.88%, 28/09/2030	189.500
200.000	Indian Railway Finance Corp Ltd, 3.84%, 13/12/2027	186.750
200.000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 3.65%, 07/05/2030	185.100
200.000	Gulf International Bank BSC, 2.38%, 23/09/2025	183.250
200.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd, 3.13%, 16/07/2025	181.598
200.000	Mexico Government International Bond, 5.00%, 27/04/2051	178.740
6.000.000	Thailand Government Bond, 1.00%, 17/06/2027	175.595
230.000	Hungary Government International Bond, 1.63%, 28/04/2032	173.775
200.000	TSMC Arizona Corp, 2.50%, 25/10/2031	168.504



## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
7.060.000	Saudi Arabian Oil Co	77.710.811
19.647.456	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	70.477.147
11.451.664	Petroleo Brasileiro SA	69.622.958
3.518.160	Saudi National Bank	63.395.463
12.544.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	62.611.904
9.490.720	Itau Unibanco Holding SA	52.862.065
2.424.000	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc Class A	52.731.992
8.446.320	Qatar National Bank QPSC	52.102.371
83.488.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	48.740.499
10.163.712	Klabin SA	46.208.270
4.487.344	Absa Group Ltd	45.689.953
59.413.344	Borouge Plc	45.610.296
23.101.344	Shenzhen Topband Co Ltd Class A	43.807.264
665.760	TCS Group Holding Plc Class S	42.877.360
1.130.544	Hana Financial Group Inc	41.062.121
28.224.000	Geely Automobile Holdings Ltd	40.981.737
5.702.800	Hiwin Technologies Corp	39.056.409
15.997.824	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A	37.002.363
7.296.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	36.833.586
1.713.616	Novatek PJSC	36.171.424
235.696	Credicorp Ltd	32.090.892
4.345.600	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	28.423.789
17.420.416	Dubai Islamic Bank PJSC	28.359.669
1.478.560	HDFC Bank Ltd	27.159.434
1.280.512	JB Chemicals & Pharmaceuticals Ltd	26.879.419
3.306.496	Montage Technology Co Ltd Class A	26.473.304
2.528.000	Yageo Corp	25.941.890
7.078.896	Cia Brasileira de Aluminio	25.319.308
987.312	First Quantum Minerals Ltd	25.047.218
4.595.200	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	24.280.822
2.080.000	Wuxi NCE Power Co Ltd Class A	23.944.387
80.000	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	23.104.284
2.197.728	ICICI Bank Ltd	23.021.860
5.280.000	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	22.958.373
43.776	LG Chem Ltd	22.555.665
715.200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	22.233.545
1.870.336	Sun Pharmaceutical Industries Ltd	21.758.905
345.600	Tencent Holdings Ltd	20.839.187
7.522.384	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	19.752.537
304.752	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	18.970.092
151.760	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	18.705.649
377.616	Anglo American Plc	18.503.632
1.281.024	Zhejiang HangKe Technology Inc Co Class A	18.425.550
901.632	Parex Resources Inc	17.838.326
318.848	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	17.833.163

## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
2.798.592	Rainbow Children's Medicare Ltd	16.422.017
167.392	SK Hynix Inc	16.026.573
1.009.600	Wingtech Technology Co Ltd Class A	16.019.993
349.520	SK Telecom Co Ltd	15.984.823
258.256	Samsung Electronics Co Ltd	15.951.692
262.128	OTP Bank Nyrt	15.262.299
3.376.000	PTT Exploration & Production PCL	15.186.031
829.312	Best Agrolife Ltd	14.837.123
1.288.352	Pagseguro Digital Ltd Class A	14.643.454
19.117.504	Americana Restaurants International Plc	13.795.814
548.384	Trip.com Group Ltd ADR	13.158.651
3.086.032	DLF Ltd	12.755.820
815.600	TDCX Inc ADR	11.694.666
499.200	Meituan Class B	11.652.948
901.632	IndusInd Bank Ltd	11.503.253
2.732.800	Xianhe Co Ltd Class A	10.185.116
11.935.888	Motherson Sumi Wiring India Ltd	10.118.193
379.312	Arabian Drilling Co	10.090.769

## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
5.451.808	Infosys Ltd ADR	108.583.118
1.379.536	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	87.407.127
1.924.528	Samsung Electronics Co Ltd	82.894.800
6.875.120	Montage Technology Co Ltd Class A	79.390.904
2.396.800	Tencent Holdings Ltd	74.872.313
812.864	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	73.479.103
26.714.576	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	71.666.678
30.305.536	Devyani International Ltd	70.063.304
12.264.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	69.781.833
3.217.600	Shenzhen SC New Energy Technology Corp Class A	64.949.054
8.853.760	State Bank of India	55.560.784
1.744.176	Reliance Industries Ltd	53.461.741
741.120	UltraTech Cement Ltd	53.222.382
4.747.776	ICICI Bank Ltd	51.038.584
2.205.696	FSN E-Commerce Ventures Ltd	49.723.631
41.233.248	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A	48.076.957
1.238.272	Gland Pharma Ltd	47.585.000
1.261.232	OTP Bank Nyrt	46.656.739
14.649.808	Vibra Energia SA	46.603.914
568.160	Kaspi.KZ JSC	46.236.545
1.978.400	JD.com Inc Class A	44.331.709
4.640.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	44.108.900
1.208.160	Yandex NV Class A	43.914.780
9.499.200	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	42.950.785
826.816	Saudi Tadawul Group Holding Co	42.768.667
1.170.576	Anglo American Plc	42.456.652
3.406.320	IndusInd Bank Ltd	42.149.383
4.584.000	Alibaba Group Holding Ltd	41.579.037
434.384	Capitec Bank Holdings Ltd	40.822.167
16.204.800	Zhejiang Juhua Co Ltd Class A	40.425.823
2.010.736	Parex Resources Inc	37.105.020
4.377.648	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	36.522.557
501.952	Dino Polska SA	34.553.971
2.152.384	Saudi National Bank	34.347.448
4.528.752	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	33.609.506
14.800.000	Hengli Petrochemical Co Ltd Class A	33.227.817
5.469.968	Petroleo Brasileiro SA	32.483.309
4.083.200	ASMPT Ltd	32.428.993
42.716.800	Ngern Tid Lor PCL	32.394.918
1.768.592	HDFC Bank Ltd	31.501.884
15.997.824	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A	31.065.992
467.152	SK Hynix Inc	30.071.130
197.424	Credicorp Ltd	28.843.689
20.633.520	Detsky Mir PJSC	27.509.441
3.661.824	Allegro.eu SA	25.698.321

## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
13.708.480	Sberbank of Russia PJSC	25.100.149
6.655.456	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	24.923.223
110.400	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	24.371.225
384.000	Largan Precision Co Ltd	24.356.068
2.158.144	AU Small Finance Bank Ltd	24.290.143
11.840.000	Uni-President Enterprises Corp	24.242.355
11.865.856	Gazprom PJSC	24.071.072
4.280.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares	23.573.620
737.488	Housing Development Finance Corp Ltd	23.535.614
211.472	Korea Petrochemical Industries Co Ltd	22.614.231
1.876.800	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	22.301.926
1.077.120	United Breweries Ltd	21.042.428
30.288.000	Greentown Management Holdings Co Ltd	20.819.866
35.606.400	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	20.762.118
27.790.016	Borouge Plc	20.579.271
385.008	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	20.286.292
44.048	LG Chem Ltd	20.133.033
5.558.400	RichWave Technology Corp	19.851.396
2.108.544	Saudi Arabian Oil Co	19.836.893
2.352.000	Accton Technology Corp	19.754.839
16.684.000	A-Living Smart City Services Co Ltd	19.313.328
3.360.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	19.117.572
37.950.976	Thai Beverage PCL	18.664.918
35.480.000	Bank Central Asia Tbk PT	18.565.666
4.346.080	Natura & Co Holding SA	18.512.622
987.312	First Quantum Minerals Ltd	18.339.597
5.392.000	Chunghwa Telecom Co Ltd	18.268.056
1.131.344	Bid Corp Ltd	18.033.392
135.920	Naspers Ltd Class N	17.956.787
1.105.936	LUKOIL PJSC ADR	17.690.828
910.144	Richter Gedeon Nyrt	17.431.220
2.014.592	TDCX Inc ADR	16.907.648

## Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
7.354.976	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	26.563.394
4.784.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	23.850.404
38.728.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	22.731.201
1.191.712	Saudi National Bank	21.483.209
3.337.856	Qatar National Bank QPSC	20.160.742
3.536.160	Itau Unibanco Holding SA	19.360.389
4.304.000	Chunghwa Telecom Co Ltd	18.193.269
22.443.856	Borouge Plc	18.121.751
274.336	TCS Group Holding Plc Class S	17.535.083
2.576.000	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	16.839.189
437.504	Hana Financial Group Inc	16.040.535
3.462.400	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	15.003.577
3.213.232	Klabin SA	14.676.786
7.729.600	Shenzhen Topband Co Ltd Class A	14.639.110
1.425.424	Absa Group Ltd	14.513.607
2.044.800	Hiwin Technologies Corp	14.372.794
433.600	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	13.961.106
8.928.000	Geely Automobile Holdings Ltd	13.461.210
105.126.400	Kalbe Farma Tbk PT	12.807.649
510.304	First Quantum Minerals Ltd	12.799.879
5.060.608	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A	11.702.624
2.192.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	11.045.544
656.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	10.782.449
78.096	Credicorp Ltd	10.572.711
915.200	Wuxi NCE Power Co Ltd Class A	10.549.220
6.194.816	Dubai Islamic Bank PJSC	10.053.835
100.208	Fabrinet	9.929.582
474.160	ICICI Bank Ltd ADR	9.460.804
880.000	Yageo Corp	9.233.523
2.394.640	Cia Brasileira de Aluminio	8.395.382
176.240	SK Telecom Co Ltd	7.965.145
271.248	Housing Development Finance Corp Ltd	7.817.400
352.000	Meituan Class B	7.705.135
171.200	Tencent Holdings Ltd	7.703.258
114.480	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	6.827.470
22.400	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	6.812.236
285.088	Trip.com Group Ltd ADR	6.728.631
9.302.640	Americana Restaurants International Plc	6.698.191
500.800	Alibaba Group Holding Ltd	6.492.493
108.944	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	6.348.086
545.200	Pagseguro Digital Ltd Class A	6.152.025
1.461.904	DLF Ltd	6.042.660
130.928	Anglo American Plc	5.939.804
2.301.664	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	5.811.002
9.152	LG Chem Ltd	4.476.193

## Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
288.000	Eclat Textile Co Ltd	4.474.966
207.488	Thoughtworks Holding Inc	4.216.904
61.360	Dino Polska SA	4.158.315
127.200	JD.com Inc Class A	3.922.224
752.000	Country Garden Services Holdings Co Ltd	3.863.925
913.600	Xianhe Co Ltd Class A	3.435.091
277.792	IndusInd Bank Ltd	3.254.328
96.016	Reliance Industries Ltd	3.174.109

## Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.642.624	Infosys Ltd ADR	33.275.290
846.704	ACC Ltd	23.449.156
1.894.880	Montage Technology Co Ltd Class A	23.218.701
3.968.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	22.634.412
477.840	Yandex NV Class A	21.933.373
236.832	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	21.464.088
1.033.600	Shenzhen SC New Energy Technology Corp Class A	20.823.017
320.736	State Bank of India GDR	19.408.297
491.104	OTP Bank Nyrt	18.262.870
6.406.704	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	16.923.501
30.337.600	Bank Central Asia Tbk PT	16.277.474
4.855.776	Vibra Energia SA	15.442.343
1.600.000	Accton Technology Corp	14.325.690
4.264.000	Hengli Petrochemical Co Ltd Class A	14.075.320
60.064	NAVER Corp	13.706.571
269.696	Saudi Tadawul Group Holding Co	13.550.949
163.792	Kaspi.KZ JSC GDR	13.171.347
5.935.136	Sberbank of Russia PJSC	12.668.438
386.096	Reliance Industries Ltd	12.114.434
99.312	Fabrinet	11.313.773
1.039.824	Indusind Bank Ltd	11.296.322
9.117.584	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A	11.168.770
923.200	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	10.969.570
2.192.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	10.968.531
640.736	AU Small Finance Bank Ltd	10.657.679
1.425.104	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	10.576.210
992.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	9.853.869
5.060.608	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A	9.852.487
118.880	Dino Polska SA	9.437.673
510.304	First Quantum Minerals Ltd	9.424.360
17.489.920	Thai Beverage PCL	8.601.775
400.000	Parade Technologies Ltd	8.426.650
3.950.736	Gazprom PJSC	8.345.219
921.600	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	8.333.660
1.184.688	Allegro.eu SA	8.314.015
527.712	Saudi National Bank	8.188.681
88.480	SK Hynix Inc	8.022.753
7.322.592	A-Living Smart City Services Co Ltd	7.744.632
234.640	Housing Development Finance Corp Ltd	7.735.129
185.136	Anglo American Plc	7.666.049
68.032	Korea Petrochemical Industries Co Ltd	7.305.919
1.167.392	Novatek PJSC	6.836.445
3.752.160	Longfor Group Holdings Ltd	6.666.956
349.424	United Breweries Ltd	6.631.548
139.776	Samsung Electronics Co Ltd	6.477.268

## Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
892.336	Inpost SA	6.269.648
1.462.960	Natura & Co Holding SA	6.231.645
416.624	LUKOIL PJSC ADR	6.004.407
1.568.000	RichWave Technology Corp	5.397.549
2.394.640	Cia Brasileira de Aluminio	5.180.175
172.656	SK Square Co Ltd	5.134.833
540.576	Thoughtworks Holding Inc	4.535.612
1.886.400	Riyue Heavy Industry Co Ltd Class A	4.479.830
664.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares	4.246.750
6.784	ASML Holding NV	3.981.615
26.672	Naspers Ltd Class N	3.914.529
4.760.608	Borouge Plc	3.504.800
606.144	State Bank of India	3.464.864



## Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
4.081.782	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.63%, 15/01/2024	3.898.752
28.180.000	Nykredit Realkredit AS, 2.50%, 01/10/2053	3.502.870
3.250.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 31/08/2022	3.258.716
3.250.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 29/07/2022	3.257.609
2.486.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.65%, 16/07/2032	2.328.390
1.796.223	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	2.085.142
1.728.000	French Republic Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	1.735.133
1.865.000	Hellenic Republic Government Bond, 1.75%, 18/06/2032	1.617.475
1.598.915	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026	1.538.761
1.407.000	Slovakia Government Bond, 4.00%, 19/10/2032	1.436.740
1.449.000	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	1.418.914
1.385.617	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	1.401.540
1.154.408	French Republic Government Bond OAT, 1.85%, 25/07/2027	1.346.238
1.246.546	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2029	1.345.542
1.338.000	Estonia Government International Bond, 4.00%, 12/10/2032	1.322.219
1.300.000	Verizon Communications Inc, 4.25%, 31/10/2030	1.311.679
1.292.690	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.60%, 22/11/2028	1.293.892
9.800.000	Nykredit Realkredit AS, 3.00%, 01/10/2053	1.172.277
1.040.770	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.10%, 15/04/2026	1.123.602
1.100.000	BPCE SA, 4.00%, 29/11/2032	1.093.774

## Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
4.093.138	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.63%, 15/01/2024	3.893.966
3.397.688	French Republic Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	3.453.003
3.250.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 29/07/2022	3.258.130
3.250.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 31/08/2022	3.254.805
25.130.371	Nykredit Realkredit AS, 2.50%, 01/10/2053	3.076.992
2.033.588	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2028	2.245.583
2.386.414	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	2.185.499
1.840.413	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	1.999.180
1.516.158	French Republic Government Bond OAT, 1.85%, 25/07/2027	1.739.826
1.624.047	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2029	1.713.160
1.561.057	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2025	1.681.135
1.650.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 14/07/2022	1.654.387
1.600.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 14/11/2022	1.604.165
1.860.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/06/2032	1.571.090
1.608.481	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	1.561.124
1.865.000	Hellenic Republic Government Bond, 1.75%, 18/06/2032	1.514.475
1.519.467	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026	1.482.847
1.449.000	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	1.386.072
1.193.241	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2026	1.253.836
9.800.000	Nykredit Realkredit AS, 3.00%, 01/10/2053	1.162.906

## Euro Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
423.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.65%, 16/07/2032	402.597
339.000	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	328.405
300.000	Verizon Communications Inc, 4.25%, 31/10/2030	302.147
292.850	French Republic Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	294.226
239.254	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	286.464
317.000	Hellenic Republic Government Bond, 1.75%, 18/06/2032	278.004
252.828	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.10%, 15/04/2026	269.054
227.000	Estonia Government International Bond, 4.00%, 12/10/2032	224.468
244.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/06/2032	221.372
201.000	Westpac Securities NZ Ltd, 1.78%, 14/01/2026	201.000
200.000	BNP Paribas SA, 6.88%, 06/06/2171	200.000
200.000	Volkswagen International Finance NV, 4.38%, 20/01/2033	200.000
200.000	Banco BPM SpA, 7.00%, 29/12/2049	200.000
200.000	Total Energies, 2.00%, 29/12/2049	200.000
200.000	Iccrea Banca SpA, 0.00%, 20/09/2027	200.000
200.000	Morgan Stanley, 2.95%, 07/05/2032	200.000
200.000	Intesa Sanpaolo, SpA, 6.38%, 29/12/2049	200.000
200.000	BPER Banca, 8.63%, 20/01/2033	200.000
200.000	UBS Group AG, 2.75%, 15/06/2027	199.896
200.000	Unicaja Banco SA, 7.25%, 15/11/2027	199.698

## Euro Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
467.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	451.672
350.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.45%, 15/11/2024	358.871
401.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 01/06/2032	336.996
321.411	French Republic Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	326.672
339.000	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	325.178
245.037	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	273.709
254.350	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.10%, 15/04/2026	260.683
317.000	Hellenic Republic Government Bond, 1.75%, 18/06/2032	256.053
243.072	French Republic Government Bond OAT, 1.00%, 25/05/2027	251.686
200.000	Booking Holdings Inc, 4.50%, 15/11/2031	205.208
200.000	Banco BPM SpA, 7.00%, 29/12/2049	204.800
200.000	Intesa Sanpaolo SpA, 6.38%, 29/12/2049	202.120
200.000	Verizon Communications Inc, 4.25%, 31/10/2030	201.842
200.000	BPER Banca, 8.63%, 20/01/2033	201.340
200.000	Bouygues SA, 3.25%, 30/06/2037	200.810
200.000	Orange SA, 2.38%, 18/05/2032	200.722
200.000	Unicaja Banco SA, 7.25%, 15/11/2027	200.612
200.000	Balder Finland OYJ, 2.00%, 18/01/2031	200.405
200.000	Morgan Stanley, 2.95%, 07/05/2032	200.396
200.000	Nordea Bank Abp, 2.50%, 23/05/2029	200.220

## European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
500.000	Electricite de France SA, 5.00%, 29/12/2049	496.054
400.000	Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049	400.000
450.000	UPC Holding BV, 3.88%, 15/06/2029	394.860
400.000	Bayer AG, 5.38%, 25/03/2082	391.012
400.000	Adient Global Holdings Ltd, 3.50%, 15/08/2024	384.050
400.000	Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027	380.713
500.000	Cellnex Telecom SA, 1.75%, 23/10/2030	380.498
350.000	Ford Motor Credit Co LLC, 2.39%, 17/02/2026	361.444
400.000	Petroleos Mexicanos, 4.75%, 26/02/2029	355.430
400.000	888 Acquisitions Ltd, 7.56%, 15/07/2027	341.384
350.000	thyssenkrupp AG, 2.88%, 22/02/2024	341.325
300.000	CMA CGM SA, 7.50%, 15/01/2026	313.450
350.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4.38%, 09/05/2030	312.292
400.000	Ziggo Bond Co BV, 3.38%, 28/02/2030	307.072
300.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025	292.840
300.000	ZF Finance GmbH, 3.00%, 21/09/2025	289.900
300.000	Intrum AB, 3.13%, 15/07/2024	286.328
250.000	Centrica Plc, 5.25%, 10/04/2075	282.623
300.000	Altice France Holding SA, 8.00%, 15/05/2027	279.815
290.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 2.88%, 30/04/2028	278.990
300.000	Faurecia SE, 2.63%, 15/06/2025	272.782
280.000	Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC, 4.00%, 15/09/2025	269.400

## European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
400.000	Electricite de France, 6.00%, 29/12/2049	455.059
400.000	Petroleos Mexicanos, 4.88%, 21/02/2028	383.263
400.000	PLT VII Finance Sarl, 4.63%, 05/01/2026	369.028
362.000	Encore Capital Group Inc, 4.88%, 15/10/2025	350.699
400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1.88%, 31/03/2027	340.681
350.000	Ford Motor Credit Co LLC, 2.39%, 17/02/2026	326.656
250.000	Rolls-Royce Plc, 5.75%, 15/10/2027	314.011
350.000	Autostrade per l'Italia SpA, 1.88%, 26/09/2029	303.853
300.000	Paprec Holding SA, 4.00%, 31/03/2025	298.400
297.000	TK Elevator Holdco GmbH, 6.63%, 15/07/2028	297.862
300.000	Schenck Process Holding GmbH, 5.38%, 15/06/2023	297.102
319.709	Summer BidCo BV, 9.00%, 15/11/2025	296.140
300.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 4.50%, 15/01/2026	294.350
300.000	Telecom Italia SpA, 3.00%, 30/09/2025	289.809
330.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 4.50%, 15/07/2028	287.911
373.000	Grupo Antolin-Irausa SA, 3.50%, 30/04/2028	286.215
304.000	Ontex Group NV, 3.50%, 15/07/2026	282.393
300.000	ZF Europe Finance BV, 3.00%, 23/10/2029	279.570
300.000	UPC Holding BV, 3.88%, 15/06/2029	273.570
300.000	Accor SA, 2.63%, 29/12/2049	268.681
300.000	PCF GmbH, 4.75%, 15/04/2026	258.488
290.000	United Group BV, 4.00%, 15/11/2027	256.389
318.000	Intrum AB, 3.00%, 15/09/2027	252.958

## European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
204.597	HelloFresh SE	7.377.711
18.736	Sartorius Stedim Biotech	6.537.672
18.530	Tecan Group AG	6.518.146
46.829	Schneider Electric SE	6.297.508
11.124	Kering SA	5.912.726
5.732	Partners Group Holding AG	5.834.967
66.641	Alfen Beheer BV	5.644.342
250.784	Assa Abloy AB Class B	5.500.854
47.563	Nestle SA	5.416.859
3.453	Adyen NV	5.376.328
59.605	London Stock Exchange Group Plc	5.368.166
374.029	3i Group Plc	5.310.813
1.191.872	S4 Capital Plc	5.257.934
68.103	Euronext NV	5.241.361
9.524	ASML Holding NV	5.040.598
52.420	Novo Nordisk A/S Class B	4.988.438
86.730	Scout24 SE	4.772.851
128.603	Zalando SE	4.733.965
18.837	VAT Group AG	4.704.419
78.788	Bakkafrost P/F	4.233.078
82.136	Dechra Pharmaceuticals Plc	3.439.247
80.788	Cellnex Telecom SA	3.088.854
300.199	Atlas Copco AB Class A	3.045.800
26.909	Straumann Holding AG	2.819.712
47.160	Amundi SA	2.669.574
11.208	SolarEdge Technologies Inc	2.541.661
25.979	Beiersdorf AG	2.507.112
113.505	CVS Group Plc	2.431.757
6.481	L'Oreal SA	2.296.895
43.045	Atlas Copco AB	2.226.756
1.387	Straumann Holding AG	2.128.266
74.209	RELX Plc	1.956.662
162.611	TeamViewer AG	1.791.830

## European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
390.757	HomeServe Plc	4.882.929
1.749.208	S4 Capital Plc	4.044.535
38.806	Novo Nordisk A/S Class B	4.007.365
31.843	Alfen Beheer BV	3.041.861
24.712	Nestle SA	2.845.693
99.409	RELX Plc	2.705.442
9.051	SolarEdge Technologies Inc	2.558.065
15.608	Schneider Electric SE	2.111.966
3.937	Sartorius Stedim Biotech	1.404.758
795	Adyen NV	1.286.433
3.434	L'Oreal SA	1.197.984
3.175	Tecan Group AG	1.182.791
53.423	Assa Abloy AB Class B	1.170.742
73.277	3i Group Plc	1.070.741
18.306	Bakkafrost P/F	1.069.246
85.732	Atlas Copco AB Class A	1.020.605
1.707	ASML Holding NV	966.155
70.238	TeamViewer AG	917.247
16.837	Scout24 SE	912.087
1.684	Kering SA	893.612
944	Partners Group Holding AG	886.352
19.072	Dechra Pharmaceuticals Plc	757.584
6.443	Straumann Holding AG	750.129
7.191	London Stock Exchange Group Plc	673.641
29.624	CVS Group Plc	642.603
7.818	Euronext NV	578.145
9.490	Amundi SA	523.936
17.414	Zalando SE	465.431



## Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/03/2023	2.971.196
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/05/2023	2.952.148
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/12/2022	2.785.640
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/12/2022	2.783.526
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 03/01/2023	2.781.556
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/01/2023	2.778.780
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/01/2023	2.776.037
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/01/2023	2.773.877
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/02/2023	2.770.917
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/03/2023	2.769.904
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/02/2023	2.768.236
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/03/2023	2.767.949
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/02/2023	2.766.500
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/02/2023	2.764.056
2.700.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/12/2022	2.692.463
13.485	Mobileye Global Inc Class A	283.185

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
13.485	Mobileye Global Inc Class A	360.184

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
126.528.000	Canadian Government Bond, 3.00%, 01/11/2024	91.689.758
67.076.800	United States Treasury Note/Bond, 0.88%, 31/01/2024	66.584.772
66.947.794	Canadian Government Real Return Bond, 4.25%, 01/12/2026	58.502.421
55.040.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024	54.956.334
72.924.000.000	Korea Treasury Bond, 2.13%, 10/06/2027	48.966.821
49.392.000	United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/05/2032	48.719.977
967.120.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	44.666.280
44.720.000	United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 31/03/2025	42.700.762
34.640.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2042	34.167.737
34.640.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2049	33.320.825
33.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/07/2053	32.697.234
31.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/03/2053	31.768.747
31.120.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2053	31.251.675
34.480.000	United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/05/2052	31.191.732
29.600.000	French Republic Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2027	29.043.838
29.920.000	United States Treasury Note/Bond, 2.75%, 15/08/2032	28.104.620
27.840.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	27.911.294
27.040.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/02/2053	27.890.594
20.777.169	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, 1.25%, 22/11/2032	27.504.417
37.066.880.000	Korea Treasury Bond, 2.38%, 10/12/2031	27.392.349
25.760.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2052	25.428.853
25.120.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2053	25.416.506
25.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/04/2053	25.290.303
28.080.000	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/02/2052	24.767.525
25.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 15/05/2042	24.370.131
24.320.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2042	24.343.163
24.320.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2053	23.949.700
24.080.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	23.872.356
23.840.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/08/2053	23.414.975
23.280.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2053	23.316.888
22.960.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	22.536.713
22.400.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/11/2022	22.214.185
22.234.011	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1A, 6.03%, 25/03/2042	22.042.937
21.152.000	United States Treasury Note/Bond, 3.25%, 30/06/2027	21.515.621
21.040.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/09/2053	21.427.806
21.040.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/08/2053	21.325.131
21.040.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/07/2052	21.322.631
519.680.000	Czech Republic Government Bond, 5.70%, 25/05/2024	21.253.590
20.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/03/2053	20.524.134
20.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/04/2053	20.506.275
21.040.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/06/2053	19.785.184
19.120.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/02/2053	19.618.766
20.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/05/2053	19.563.350
25.264.000	Canadian Government Bond, 2.25%, 01/06/2029	19.246.342
18.480.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/04/2053	18.862.725

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
300.992.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/04/2032	18.796.054
16.375.360	Netherlands Government Bond, 2.50%, 15/01/2033	18.468.559
18.080.000	Anglo American Capital Plc, 4.75%, 21/09/2032	18.066.984
18.080.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2032	18.023.757
17.840.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/10/2052	17.943.019
17.440.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/09/2053	17.336.663
16.880.000	French Republic Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	17.155.988
11.882.832	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.50%, 15/04/2030	16.599.548
16.400.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2053	16.582.359

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
116.672.000	United States Treasury Note/Bond, 0.13%, 28/02/2023	115.837.587
7.834.400.000	Japan Government Twenty Year Bond, 1.50%, 20/03/2034	74.884.780
73.344.000	United States Treasury Note/Bond, 2.13%, 31/12/2022	73.146.889
55.040.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024	55.179.566
6.635.200.000	Japan Government Ten Year Bond, 0.10%, 20/12/2028	49.748.093
45.600.000	French Republic Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2027	43.893.013
52.160.000	International Bank for Reconstruction & Development, 2.50%, 03/08/2023	41.128.418
50.912.000	Canadian Government Bond, 1.50%, 01/06/2031	33.780.291
34.640.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2053	33.668.525
34.640.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2042	33.402.012
33.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/07/2053	32.442.288
31.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/03/2053	31.485.403
31.120.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2053	31.063.812
61.520.000	New Zealand Government Bond, 1.50%, 15/05/2031	30.937.511
31.008.000	United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/05/2032	29.756.523
28.080.000	Australia Government Bond, 2.00%, 21/08/2035	29.664.286
27.840.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	27.964.025
27.040.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/01/2053	27.931.787
27.776.000	Spain Government Bond, 0.35%, 30/07/2023	27.584.692
27.040.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/02/2053	27.584.666
25.760.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2052	25.318.675
25.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/04/2053	24.427.647
24.320.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2053	24.223.588
24.320.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2042	24.021.900
25.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 15/05/2042	23.951.950
24.080.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	23.695.337
23.840.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/08/2053	23.668.575
23.280.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2053	23.552.100
22.960.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	23.257.556
28.400.000	Canada Housing Trust No 1, 2.90%, 15/06/2024	23.047.162
519.680.000	Czech Republic Government Bond, 5.70%, 25/05/2024	22.814.164
22.400.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/11/2022	22.362.203
29.520.000	Province of Ontario Canada, 2.90%, 02/06/2028	22.002.943
28.080.000	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/02/2052	21.818.731
21.040.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/08/2053	21.475.475
21.040.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/07/2052	21.372.037
20.048.000	French Republic Government Bond OAT, 2.25%, 25/05/2024	21.249.915
21.040.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/09/2053	21.214.591
20.800.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/01/2053	21.087.344
22.480.000	United States Treasury Note/Bond, 2.75%, 15/08/2032	20.776.507
20.576.000	United States Treasury Note/Bond, 3.25%, 30/06/2027	20.621.191
20.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/03/2053	20.552.169
21.040.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/06/2053	19.699.772
19.120.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/01/2053	19.655.363
20.016.000	French Republic Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	19.654.867

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
20.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/04/2053	19.614.741
30.432.000	Province of Ontario Canada, 1.35%, 02/12/2030	19.584.640
19.120.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/02/2053	19.432.919
20.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/05/2053	19.249.831
18.207.346	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2, 5.97%, 25/05/2029	19.026.676
18.480.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/04/2053	18.465.563
18.432.000	United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/05/2051	18.292.059
23.296.000	Province of Ontario Canada, 2.70%, 02/06/2029	18.207.306
18.080.000	Anglo American Capital Plc, 4.75%, 21/09/2032	18.000.582
16.208.000	Glencore Finance Europe Ltd, 3.75%, 01/04/2026	17.926.938
18.080.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2032	17.866.437
17.840.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/10/2052	17.487.638
16.880.000	French Republic Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	17.083.402
17.440.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/09/2053	16.972.525

## Global Diversified Income FMP - 2024 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
4.200.000	Sabine Pass Liquefaction LLC, 5.75%, 15/05/2024	4.290.132
4.000.000	Warnermedia Holdings Inc, 3.53%, 15/03/2024	3.984.560
4.100.000	Athene Global Funding, 2.75%, 25/06/2024	3.957.935
1.745.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 5.13%, 15/05/2024	1.714.463
1.670.000	Sprint LLC, 7.13%, 15/06/2024	1.698.557
1.570.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.25%, 15/04/2024	1.562.091
1.550.000	Starwood Property Trust Inc, 5.50%, 01/11/2023	1.550.797
1.500.000	Ares Capital Corp, 4.20%, 10/06/2024	1.505.655
1.175.000	CSC Holdings LLC, 5.25%, 01/06/2024	1.178.938
1.155.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 5.63%, 15/06/2024	1.130.237
1.050.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 9.13%, 15/06/2023	1.103.025
1.040.000	Lumen Technologies Inc, 7.50%, 01/04/2024	1.089.400
1.025.000	Seagate HDD Cayman, 4.88%, 01/03/2024	1.015.578
1.000.000	HSBC Holdings Plc, 4.25%, 14/03/2024	1.011.840
1.040.000	Ford Motor Credit Co LLC, 3.81%, 09/01/2024	1.005.815
635.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp, 4.25%, 30/05/2023	632.619
620.000	Buckeye Partners LP, 4.15%, 01/07/2023	615.059
550.000	United Airlines Holdings Inc, 5.00%, 01/02/2024	552.063
550.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 5.63%, 01/02/2023	550.165
510.000	Hanesbrands Inc, 4.63%, 15/05/2024	493.874

## Global Diversified Income FMP - 2024 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
5.000.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 4.50%, 15/09/2023	4.956.500
4.550.000	Boeing Co, 4.51%, 01/05/2023	4.543.130
4.300.000	Energy Transfer LP, 4.50%, 15/04/2024	4.306.708
4.300.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp, 3.85%, 15/10/2023	4.241.176
4.200.000	Sabine Pass Liquefaction LLC, 5.75%, 15/05/2024	4.208.946
4.000.000	Pacific Gas and Electric Co, 3.75%, 15/02/2024	3.910.470
3.750.000	Glencore Funding LLC, 4.63%, 29/04/2024	3.708.675
3.000.000	HSBC Holdings Plc, 4.25%, 14/03/2024	2.953.020
2.750.000	Turkey Government International Bond, 5.75%, 22/03/2024	2.624.838
2.000.000	Air Lease Corp, 4.25%, 01/02/2024	1.966.380
1.745.000	United Airlines Holdings Inc, 5.00%, 01/02/2024	1.718.825
1.700.000	QNB Finansbank AS, 6.88%, 07/09/2024	1.705.102
1.660.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 5.50%, 15/04/2024	1.618.500
1.580.000	Service Properties Trust, 4.65%, 15/03/2024	1.516.800
1.250.000	Lennar Corp, 4.50%, 30/04/2024	1.235.338
3.083.000	Ukraine Government International Bond, 8.99%, 01/02/2026	1.186.955
1.100.000	EnerSys, 5.00%, 30/04/2023	1.096.700
1.050.000	Live Nation Entertainment Inc, 4.88%, 01/11/2024	1.023.750
1.090.000	CSC Holdings LLC, 5.25%, 01/06/2024	1.013.700
1.025.000	Seagate HDD Cayman, 4.88%, 01/03/2024	1.007.913
1.000.000	Sunny Optical Technology Group Co Ltd, 3.75%, 23/01/2023	998.130
1.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 3.38%, 24/07/2024	950.300
1.000.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.25%, 13/11/2024	923.500
2.139.000	VEON Holdings BV, 7.25%, 26/04/2023	855.600
2.689.000	Sunac China Holdings Ltd, 7.50%, 01/02/2024	840.910

## Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
14.265	Alphabet Inc Class A	2.966.485
692.020	Pets at Home Group Plc	2.821.996
23.748	Expedia Group Inc	2.737.522
77.130	Criteo SA ADR	2.193.537
22.070	Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.035.200
15.931	TE Connectivity Ltd	1.879.646
17.733	ModivCare Inc	1.825.873
33.594	Stericycle Inc	1.602.413
106.969	Despegar.com Corp	818.174
23.777	Corning Inc	811.896
24.871	Delta Air Lines Inc	764.986
30.569	Gen Digital Inc	685.190
112.591	Paya Holdings Inc	616.658
89.611	Zeta Global Holdings Corp Class A	516.984
9.880	Western Digital Corp	409.520
11.516	Scholastic Corp	374.765
5.620	Perrigo Co Plc	205.087
21.112	Element Fleet Management Corp	203.206
8.277	Vistra Corp	176.757
279	Aon Plc Class A	78.319



## Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
137.146	ATI Inc	3.344.896
85.497	Western Digital Corp	3.034.964
77.264	Vistra Corp	1.764.243
14.738	Amdocs Ltd	1.228.889
3.849	Charles River Laboratories International Inc	813.955
105.105	Paya Holdings Inc	624.943
12.889	Scholastic Corp	543.714
11.492	Delta Air Lines Inc	450.268
12.369	Corning Inc	446.037
2.169	Expedia Group Inc	377.427
22.087	Element Fleet Management Corp	262.230
20.179	Despegar.com Corp	222.699
4.290	Perrigo Co Plc	161.940
6.138	Criteo SA ADR	156.366
536	Aon Plc Class A	153.400
1.110	Quanta Services Inc	145.625
1.515	Alibaba Group Holding Ltd ADR	144.049
33.109	Pets at Home Group Plc	129.208
1.143	ModivCare Inc	112.787
669	Tetra Tech Inc	95.042

## Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
6.050.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	5.704.388
4.960.000	Athenahealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030	4.960.228
5.000	Mcafee Pik Pref Equity	4.900.000
4.685.000	Condor Merger Sub Inc, 7.38%, 15/02/2030	4.651.000
4.035.000	Summit Midstream Holdings LLC, 8.50%, 15/10/2026	4.005.141
3.615.000	Rogers Communications Inc, 3.80%, 15/03/2032	3.606.939
3.387.367	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 5.88%, 15/10/2027	3.438.177
3.480.000	CVS Health Corp, 5.05%, 25/03/2048	3.425.125
3.165.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc, 6.38%, 01/02/2030	3.013.700
2.850.000	Truist Financial Corp, 5.10%, 29/12/2049	2.933.750
3.235.000	M&T Bank Corp, 3.50%, 29/12/2049	2.917.056
2.895.000	Select Medical Corp, 6.25%, 15/08/2026	2.913.094
3.000.000	Paramount Global, 6.38%, 30/03/2062	2.886.600
3.000.000	Wells Fargo & Co, 3.90%, 29/12/2049	2.863.500
3.000.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	2.748.700
2.985.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.13%, 17/08/2027	2.708.888
3.320.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.25%, 01/02/2031	2.680.900
3.000.000	Charles Schwab Corp, 4.00%, 29/12/2049	2.677.500
2.940.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031	2.631.300
2.900.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081	2.533.173

## Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
8.285.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031	7.664.385
6.110.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	5.822.584
6.690.000	AssuredPartners Inc, 5.63%, 15/01/2029	5.637.928
5.650.000	Calpine Corp, 4.63%, 01/02/2029	5.040.982
5.400.000	Goldman Sachs Group Inc, 4.95%, 29/12/2049	4.933.512
6.205.000	CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030	4.728.063
5.555.000	Carnival Corp, 5.75%, 01/03/2027	4.644.872
5.630.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.75%, 15/01/2029	4.559.840
4.575.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 5.75%, 15/01/2028	4.551.300
3.915.000	Ford Motor Co, 7.40%, 01/11/2046	4.531.088
4.960.000	Athenahealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030	4.491.552
4.590.000	Frontier Communications Holdings LLC, 5.88%, 15/10/2027	4.487.683
5.435.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 6.50%, 15/02/2029	4.478.218
4.450.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029	4.403.950
4.290.000	Garda World Security Corp, 9.50%, 01/11/2027	4.356.241
4.070.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 7.50%, 15/10/2027	4.238.613
4.500.000	JPMorgan Chase & Co, 5.00%, 29/12/2049	4.162.595
4.500.000	Citigroup Inc, 5.00%, 29/12/2049	4.068.790
5.010.000	MPH Acquisition Holdings LLC, 5.75%, 01/11/2028	3.967.668
3.878.000	Comstock Resources Inc, 6.75%, 01/03/2029	3.863.429

## Global High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
3.235.000	Iron Mountain Inc, 4.88%, 15/09/2027	3.117.983
3.075.000	EQM Midstream Partners LP, 6.50%, 01/07/2027	3.013.307
3.925.000	CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030	2.876.840
3.035.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 5.88%, 30/06/2029	2.809.265
2.795.000	GTCR AP Finance Inc, 8.00%, 15/05/2027	2.729.697
2.650.000	Solaris Midstream Holdings LLC, 7.63%, 01/04/2026	2.643.332
2.890.000	Sensata Technologies BV, 4.00%, 15/04/2029	2.624.505
3.015.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	2.478.564
2.880.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.50%, 01/06/2033	2.377.824
2.450.000	New Fortress Energy Inc, 6.75%, 15/09/2025	2.373.461
2.420.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.69%, 09/06/2025	2.372.198
2.380.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.75%, 15/04/2026	2.320.787
2.301.000	Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027	2.285.852
2.645.000	Medline Borrower LP, 3.88%, 01/04/2029	2.284.356
2.430.000	ASGN Inc, 4.63%, 15/05/2028	2.243.368
2.690.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.25%, 15/04/2030	2.152.315
2.199.000	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028	2.119.730
2.445.000	CHS/Community Health Systems Inc, 6.00%, 15/01/2029	2.117.861
1.900.000	Telefonica Europe BV, 4.38%, 29/12/2049	2.055.173
2.068.000	Verisure Holding AB, 3.88%, 15/07/2026	2.053.495

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
2.015.000	Novelis Corp, 4.75%, 30/01/2030	1.727.863
1.752.000	United Group BV, 4.88%, 01/07/2024	1.679.596
1.555.000	Athenahealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030	1.401.238
1.385.000	Tenet Healthcare Corp, 6.13%, 01/10/2028	1.316.649
1.350.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 6.13%, 15/04/2032	1.256.528
1.350.000	eG Global Finance Plc, 6.25%, 30/10/2025	1.246.127
1.125.000	Range Resources Corp, 8.25%, 15/01/2029	1.165.300
1.340.000	Ford Motor Co, 3.25%, 12/02/2032	1.018.352
1.060.000	NextEra Energy Operating Partners LP, 4.50%, 15/09/2027	994.185
1.035.000	Iron Mountain Inc, 4.88%, 15/09/2027	960.069
1.000.000	Altice Financing SA, 2.25%, 15/01/2025	958.919
1.085.000	Post Holdings Inc, 4.63%, 15/04/2030	899.194
936.000	Alsea SAB de CV, 7.75%, 14/12/2026	887.502
864.000	FS Luxembourg Sarl, 10.00%, 15/12/2025	881.076
1.201.000	Movida Europe SA, 5.25%, 08/02/2031	874.581
1.105.000	Hudbay Minerals Inc, 6.13%, 01/04/2029	864.547
885.000	New Fortress Energy Inc, 6.75%, 15/09/2025	858.197
1.001.000	Bancolombia SA, 4.63%, 18/12/2029	822.623
805.000	Entegris Escrow Corp, 5.95%, 15/06/2030	779.756
927.000	Banco Mercantil del Norte SA, 7.50%, 29/12/2049	778.888

## Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
200.000	VZ Secured Financing BV, 5.00%, 15/01/2032	198.060
185.000	HCA Inc, 5.38%, 01/02/2025	188.939
185.000	Tenet Healthcare Corp, 4.88%, 01/01/2026	179.175
180.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	156.038
100.000	Zenith Finco Plc, 6.50%, 30/06/2027	136.555
100.000	Telefonica Europe BV, 4.38%, 29/12/2049	119.134
120.000	Trinseo Materials Operating SCA/Trinseo Materials Finance Inc, 5.38%, 01/09/2025	117.600
120.000	Ford Motor Credit Co LLC, 3.66%, 08/09/2024	116.128
100.000	Infineon Technologies AG, 2.88%, 29/12/2049	114.670
100.000	Vodafone Group Plc, 3.10%, 03/01/2079	114.614
100.000	Faurecia SE, 2.75%, 15/02/2027	113.816
100.000	CPUK Finance Ltd, 6.50%, 28/08/2026	112.989
115.000	Centene Corp, 4.25%, 15/12/2027	110.783
100.000	Canpack SA/Canpack US LLC, 2.38%, 01/11/2027	109.409
115.000	United Rentals North America Inc, 4.88%, 15/01/2028	109.287
100.000	Accor SA, 2.63%, 29/12/2049	107.393
100.000	United Group BV, 6.52%, 01/02/2029	106.276
100.000	eG Global Finance Plc, 3.63%, 07/02/2024	101.898
100.000	Huhtamaki OYJ, 4.25%, 09/06/2027	101.498
100.000	Banjay Entertainment SASU, 3.50%, 01/03/2025	100.826
100.000	Casino Guichard Perrachon SA, 4.50%, 07/03/2024	98.894
100.000	Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027	97.874
100.000	DKT Finance ApS, 7.00%, 17/06/2023	96.300
100.000	Assemblin Financing AB, 7.05%, 15/05/2025	95.226
95.000	Starwood Property Trust, 4.38%, 15/01/2027	94.250
100.000	Altice France SA, 2.50%, 15/01/2025	93.056
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025	92.879
100.000	Iliad Holding SASU, 5.13%, 15/10/2026	92.801
100.000	BK LC Lux Finco1 Sarl, 5.25%, 30/04/2029	91.123
100.000	Paganini Bidco SpA, 5.89%, 30/10/2028	90.877
100.000	Infineon Technologies AG, 3.63%, 29/12/2049	90.874
100.000	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028	90.584
100.000	Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027	88.790
90.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 5.88%, 15/04/2030	88.400
100.000	doValue SpA, 3.38%, 31/07/2026	87.717
90.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 5.88%, 15/02/2028	87.300
90.000	Standard Industries Inc, 5.00%, 15/02/2027	87.075
100.000	Accor SA, 4.38%, 29/12/2049	86.478
100.000	Nomad Foods Bondco Plc, 2.50%, 24/06/2028	85.827
85.000	IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026	84.756

## Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
290.000	Trinseo Materials Operating SCA/Trinseo Materials Finance Inc, 5.38%, 01/09/2025	279.300
265.000	Ingevity Corp, 4.50%, 01/02/2026	267.723
260.000	Carvana Co, 5.50%, 15/04/2027	219.400
210.000	IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026	213.650
225.000	Ford Motor Co, 3.25%, 12/02/2032	211.699
230.000	DaVita Inc, 4.63%, 01/06/2030	208.400
170.000	Pattern Energy Operations LP/Pattern Energy Operations Inc, 4.50%, 15/08/2028	162.563
165.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	152.088
150.000	Hilton Worldwide Finance LLC/Hilton Worldwide Finance Corp, 4.88%, 01/04/2027	147.100
200.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC, 6.50%, 15/02/2029	146.804
125.000	Altice France SA, 5.88%, 01/02/2027	143.942
140.000	Hologic Inc, 4.63%, 01/02/2028	139.525
130.000	MEDNAX Inc, 6.25%, 15/01/2027	136.338
135.000	Tenet Healthcare Corp, 6.13%, 01/10/2028	134.425
130.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co Issuer LLC, 6.00%, 15/09/2028	122.850
125.000	SBA Communications Corp, 3.88%, 15/02/2027	119.849
100.000	Virgin Media Finance Plc, 3.75%, 15/07/2030	113.186
130.000	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4.75%, 15/07/2031	110.581
135.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 4.00%, 01/09/2029	108.465
105.000	Clean Harbors Inc, 5.13%, 15/07/2029	104.081
100.000	La Financiere Atalian SASU, 4.00%, 15/05/2024	104.021
125.000	CommScope Inc, 7.13%, 01/07/2028	101.745
105.000	Cedar Fair LP, 5.25%, 15/07/2029	98.800
100.000	Vodafone Group Plc, 3.10%, 03/01/2079	97.251
100.000	Casino Guichard Perrachon SA, 6.63%, 15/01/2026	96.992
100.000	Infineon Technologies AG, 2.88%, 29/12/2049	96.242
90.000	NextEra Energy Operating Partners LP, 4.50%, 15/09/2027	88.800
100.000	Clearway Energy Operating LLC, 3.75%, 15/02/2031	88.375
100.000	LPL Holdings Inc, 4.00%, 15/03/2029	88.250
100.000	Iceland Bondco Plc, 4.38%, 15/05/2028	86.623
95.000	United Rentals North America Inc, 4.00%, 15/07/2030	84.273
100.000	PCF GmbH, 4.75%, 15/04/2026	83.828
95.000	Sunnova Energy Corp, 5.88%, 01/09/2026	83.384
100.000	Aedas Homes Opco SLU, 4.00%, 15/08/2026	81.907
100.000	Accor SA, 2.63%, 29/12/2049	80.684
85.000	Medline Borrower LP, 3.88%, 01/04/2029	79.156
75.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc, 5.38%, 15/01/2025	74.250
75.000	Acadia Healthcare Co Inc, 5.50%, 01/07/2028	73.313
80.000	Cornerstone Building Brands Inc, 6.13%, 15/01/2029	69.450
75.000	Hanesbrands Inc, 4.88%, 15/05/2026	69.438
100.000	Casino Guichard Perrachon SA, 4.50%, 07/03/2024	69.190

## Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
5.700.000	United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/04/2025	5.653.777
1.850.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2032	1.672.171
1.000.000	Bank of America Corp, 1.95%, 27/10/2026	1.086.550
910.000	Total Energies, 1.63%, 29/12/2049	952.986
785.000	Baltimore Gas & Electric Co, 4.55%, 01/06/2052	783.603
750.000	Diamondback Energy Inc, 6.25%, 15/03/2033	746.790
775.000	Citigroup Inc, 3.89%, 10/01/2028	740.166
702.000	Anglo American Capital Plc, 4.75%, 21/09/2032	701.495
775.000	Bank of America Corp, 1.90%, 23/07/2031	644.606
640.000	GE HealthCare Technologies Inc, 5.60%, 15/11/2025	643.955
685.000	MPLX LP, 4.00%, 15/03/2028	641.532
640.000	F&G Global Funding, 5.15%, 07/07/2025	639.578
640.000	Diamondback Energy Inc, 4.25%, 15/03/2052	638.170
820.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/11/2051	624.748
635.000	United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/08/2042	598.564
600.000	Electricite de France SA, 4.75%, 12/10/2034	583.944
570.000	Dominion Energy Inc, 5.38%, 15/11/2032	574.292
545.000	Toll Brothers Finance Corp, 3.80%, 01/11/2029	570.310
570.000	ArcelorMittal SA, 6.55%, 29/11/2027	569.476
675.000	Abbvie Inc, 4.05%, 21/11/2039	558.725

## Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
2.835.000	United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/04/2025	2.717.544
1.459.000	Wells Fargo & Co, 2.00%, 27/04/2026	1.622.105
1.850.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2032	1.604.247
1.003.000	Volkswagen Bank GmbH, 1.25%, 15/12/2025	1.129.772
1.001.000	Glencore Finance Europe Ltd, 3.75%, 01/04/2026	1.068.055
1.000.000	Hewlett Packard Enterprise Co, 4.40%, 15/10/2022	1.012.520
1.000.000	Bank of America Corp, 3.55%, 05/03/2024	1.001.350
1.000.000	Standard Chartered Plc, 1.32%, 14/10/2023	990.980
900.000	Healthpeak Properties Inc, 3.25%, 15/07/2026	927.909
900.000	Lennar Corp, 4.75%, 29/11/2027	921.492
800.000	National Grid North America Inc, 1.00%, 12/07/2024	908.313
910.000	Total Energies, 1.63%, 29/12/2049	816.856
942.000	Dow Chemical Co, 1.13%, 15/03/2032	813.355
800.000	Orange SA, 0.50%, 04/09/2032	731.050
700.000	Credit Suisse Group AG, 3.00%, 14/12/2023	698.201
713.000	AT&T Inc, 0.25%, 04/03/2026	690.574
820.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/11/2051	621.962
640.000	Diamondback Energy Inc, 4.25%, 15/03/2052	618.202
700.000	Credit Suisse Group AG, 4.19%, 01/04/2031	616.553
599.000	Anglo American Capital Plc, 4.75%, 21/09/2032	599.934



## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
59.856.000	United States Treasury Note/Bond,, 1.50%, 29/02/2024	59.888.732
54.336.000	United States Treasury Note/Bond,, 3.00%, 30/06/2024	54.368.020
261.920.000	China Government Bond, 2.56%, 21/10/2023	41.153.966
368.000	iShares USD Corporate Bond UCITS ETF	40.206.318
56.736.000	New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033	40.007.281
39.600.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2053	39.366.403
38.800.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2053	39.234.072
39.600.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2053	38.823.931
36.000.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	35.689.969
216.000.000	China Government Bond, 2.26%, 24/02/2025	33.665.348
33.520.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2053	33.023.184
32.640.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2042	32.639.469
33.760.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2053	31.623.394
31.600.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/08/2053	31.029.634
199.040.000	China Government Bond, 2.37%, 20/01/2027	30.901.185
29.040.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2053	29.189.356
27.696.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024	27.356.561
26.000.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/09/2053	25.859.941
25.952.000	United States Treasury Note/Bond, 1.50%, 15/02/2025	25.842.602
27.120.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2052	24.475.475
25.120.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/10/2053	24.363.347
24.320.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/07/2053	23.547.031
23.120.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2053	23.140.212
22.720.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	22.833.969
486.400.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	22.781.356
22.800.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/10/2053	22.448.797
23.296.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2032	22.447.007
22.960.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2053	22.089.788
22.400.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2042	22.053.609
23.600.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2053	21.399.853
20.240.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/04/2053	20.265.525
19.840.000	United States Treasury Note/Bond, 3.25%, 30/06/2027	19.731.446
20.240.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 15/05/2042	19.508.769
19.040.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2053	19.285.813
18.480.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/03/2053	18.771.706
18.320.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	18.043.541
18.480.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/01/2053	17.984.041
18.880.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/11/2052	17.722.125
18.480.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/11/2052	17.647.628
18.480.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/12/2052	17.304.297
336.000	iShares J.P. Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	17.208.240
16.640.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/02/2053	17.115.169
17.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/08/2053	16.974.475
15.680.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2053	15.988.044
16.800.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/01/2053	15.941.625

## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
15.680.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2053	15.814.181
16.800.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/12/2052	15.192.350
15.920.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/09/2053	14.637.809
15.920.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/08/2053	14.436.703
14.240.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/09/2053	14.052.803
14.000.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/10/2052	13.997.425
13.920.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/01/2053	13.823.375
14.240.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/10/2053	13.483.500
77.440.000	China Government Bond, 3.53%, 18/10/2051	12.536.563
12.160.000	Fannie Mae, 6.00%, 01/01/2053	12.443.853
12.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/03/2053	12.409.181
12.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/04/2053	12.398.400

## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
453.440.000	China Government Bond, 3.02%, 27/05/2031	71.845.814
1.456.000	iShares J.P. Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	69.957.160
59.856.000	United States Treasury Note/Bond, 1.50%, 29/02/2024	59.041.920
54.336.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 30/06/2024	53.396.087
50.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/06/2022	49.994.684
41.936.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.95%, 15/09/2027	41.493.785
38.800.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/01/2053	39.329.556
39.600.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2053	38.898.181
38.800.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2053	38.674.450
39.600.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2053	37.260.472
368.000	iShares USD Corporate Bond UCITS ETF	37.221.029
36.000.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	35.401.416
33.520.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2053	33.413.075
32.640.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2042	32.246.306
31.600.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/08/2053	31.417.300
33.760.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2053	30.618.431
29.040.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2053	28.827.800
23.392.000	Spain Government Bond, 1.95%, 30/07/2030	26.868.355
26.000.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/09/2053	25.255.559
25.952.000	United States Treasury Note/Bond, 1.50%, 15/02/2025	25.022.304
27.120.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2052	24.743.441
25.120.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/10/2053	23.550.138
23.120.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2053	23.385.781
24.320.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/07/2053	23.262.412
22.720.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	22.783.644
22.960.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2053	22.331.175
22.800.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/10/2053	21.805.037
22.400.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2042	21.598.213
23.600.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2053	21.268.338
25.760.000	Canada Housing Trust No 1, 2.90%, 15/06/2024	20.904.749
20.240.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/04/2053	19.554.963
20.240.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 15/05/2042	19.090.337
128.160.000	China Government Bond, 2.26%, 24/02/2025	19.046.749
18.480.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/03/2053	18.588.644
125.920.000	China Government Bond, 2.37%, 20/01/2027	18.573.321
18.320.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	18.572.412
17.815.746	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2, 2.75%, 25/12/2029	18.408.640
17.791.491	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2, 2.60%, 25/03/2030	18.277.555
18.480.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/12/2042	17.981.153
28.816.000	New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033	17.496.146
17.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/08/2053	17.486.475
18.480.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/11/2052	17.318.734
18.880.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/11/2052	17.100.200
16.640.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/02/2053	16.970.244
16.800.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/12/2052	15.936.375

## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
15.680.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2053	15.890.744
15.680.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2053	15.863.575
16.608.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2032	15.150.723
12.020.800	United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 15/02/2044	15.100.888
99.040.000	China Government Bond, 2.56%, 21/10/2023	14.862.135
15.920.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/08/2053	14.647.138
15.920.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/09/2053	14.022.550
14.000.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/10/2052	13.726.219
14.240.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/09/2053	13.494.625
12.640.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/01/2053	13.055.675
12.800.000	SSE Plc, 4.75%, 16/09/2077	12.953.600
14.240.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/10/2052	12.920.737
12.240.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/03/2053	12.426.097
11.760.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/01/2053	12.085.284

## Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
316.500	CK Asset Holdings Ltd	2.064.485
87.700	Mitsui Fudosan Co Ltd	1.875.458
10.825	Prologis Inc	1.499.672
26.390	Ventas Inc	1.455.505
96.300	Mitsubishi Estate Co Ltd	1.403.888
18.711	Realty Income Corp	1.242.702
397.083	Charter Hall Retail REIT	1.197.146
55.754	RioCan Real Estate Investment Trust	1.065.695
6.420	Crown Castle Inc	1.054.340
4.090	American Tower Corp	1.015.470
462.867	Shopping Centres Australasia Property Group	920.121
11.270	Welltower Inc	915.686
171.500	UOL Group Ltd	888.669
2.601	Public Storage	846.267
66.466	Segro Plc	748.328
5.337	Digital Realty Trust Inc	716.003
13.392	Iron Mountain Inc	693.871
6.207	Simon Property Group Inc	676.769
245.600	Swire Properties Ltd	661.400
24.515	Healthpeak Properties Inc	651.617
17.555	Cellnex Telecom SA	650.910
144.000	China Resources Land Ltd	637.209
10.627	Duke Realty Corp	592.972
6.875	Gecina SA	569.593
106.776	Great Portland Estates Plc	562.014
36.384	Safestore Holdings Plc	552.572
1.878	Essex Property Trust Inc	549.240
36.817	Medical Properties Trust Inc	531.048
6.342	Equity Residential	521.461
85.800	Link REIT	518.530
37.590	UNITE Group Plc	515.185
8.762	Brookfield Corp Class A	458.658
37.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	453.733
10.043	UDR Inc	447.149
79.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	431.725
2.607	Sun Communities Inc	421.972
603	Equinix Inc	416.828
97	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc	414.873
532.762	HomeCo Daily Needs REIT	397.821

## Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
17.706	Prologis Inc	2.204.767
125.706	Mitsubishi Estate Co Ltd	1.852.417
75.260	Nomura Real Estate Holdings Inc	1.772.882
110.119	Segro Plc	1.702.421
565.000	Swire Properties Ltd	1.370.502
174.500	CK Asset Holdings Ltd	1.056.027
9.451	Simon Property Group Inc	1.046.820
6.748	Crown Castle Inc	1.043.858
89.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	1.021.233
4.043	American Tower Corp	979.961
13.247	Equity Residential	963.975
310.334	Charter Hall Long Wale REIT	907.153
1.345	Equinix Inc	906.012
17.987	Brookfield Corp Class A	831.259
72.193	UNITE Group Plc	754.864
10.931	Equity LifeStyle Properties Inc	754.161
69.116	Safestore Holdings Plc	737.675
8.866	Welltower Inc	713.791
21.356	VICI Properties Inc	669.606
295.070	Scentre Group	654.054
76.805	Dexus	626.311
24.617	Healthpeak Properties Inc	602.485
124.500	UOL Group Ltd	598.253
29.100	Mitsui Fudosan Co Ltd	584.679
19.926	Healthcare Trust of America Inc Class A	554.371
1.717	Public Storage	543.504
11.850	Ventas Inc	541.631
14.421	Weyerhaeuser Co	522.599
9.486	Duke Realty Corp	521.773
11.713	Vonovia SE	519.035
532.762	HomeCo Daily Needs REIT	474.801
63.300	Link REIT	444.507
82.657	DigitalBridge Group Inc	430.869
164.564	Charter Hall Retail REIT	415.969
7.882	Kilroy Realty Corp	406.175
306.000	Sino Land Co Ltd	395.972
1.478	Essex Property Trust Inc	386.337

## Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
10.926	Alphabet Inc Class A	8.206.633
11.730	Amazon.com Inc	6.717.410
48.238	NIKE Inc Class B	5.106.454
2.689	Adyen NV	4.850.650
28.431	Marsh & McLennan Cos Inc	4.658.362
103.728	HelloFresh SE	4.555.472
17.128	Microsoft Corp	4.490.766
14.306	Netflix Inc	4.307.746
10.756	S&P Global Inc	4.203.933
839.315	S4 Capital Plc	4.161.728
16.488	Estee Lauder Cos Inc Class A	4.006.502
30.043	Applied Materials Inc	3.894.981
7.940	UnitedHealth Group Inc	3.891.956
8.097	Intuit Inc	3.842.768
42.532	Alfen Beheer BV	3.736.161
6.556	Thermo Fisher Scientific Inc	3.727.680
141.779	Assa Abloy AB Class B	3.509.221
7.723	Adobe Inc	3.343.606
20.740	Nasdaq Inc	3.107.931
50.290	Brown & Brown Inc	3.086.452
7.973	Ulta Beauty Inc	3.070.571
32.348	Match Group Inc	2.718.160
39.177	Bakkafrost P/F	2.531.215
7.558	Moody's Corp	2.488.870
4.587	ASML Holding NV	2.477.501
1.617	Straumann Holding AG	2.447.330
11.597	Zoetis Inc Class A	2.160.728
7.796	SolarEdge Technologies Inc	2.146.500
124.287	3i Group Plc	2.054.312
4.244	Elevance Health Inc	1.958.553
1.485	Partners Group Holding AG	1.944.938
45.600	Recruit Holdings Co Ltd	1.915.643
12.332	Nestle SA	1.524.403
4.278	Mastercard Inc Class A	1.461.995
5.038	Danaher Corp	1.367.168

## Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
42.031	Amazon.com Inc	7.096.503
13.512	UnitedHealth Group Inc	6.885.131
26.185	Microsoft Corp	6.628.350
44.038	Alphabet Inc Class A	5.403.803
77.696	Brown & Brown Inc	4.960.042
337.864	HomeServe Plc	4.429.922
10.610	Ulta Beauty Inc	4.268.506
12.044	Mastercard Inc Class A	4.034.298
13.391	SolarEdge Technologies Inc	4.034.272
9.771	Intuit Inc	4.007.728
6.517	ASML Holding NV	3.756.707
1.510.405	S4 Capital Plc	3.743.040
13.361	Netflix Inc	3.648.208
6.754	Thermo Fisher Scientific Inc	3.621.239
29.566	Nestle SA	3.618.586
10.309	S&P Global Inc	3.510.548
34.656	Alfen Beheer BV	3.407.030
16.757	Visa Inc Class A	3.341.181
33.108	Applied Materials Inc	3.325.180
38.177	Nasdaq Inc	3.097.166
53.072	Bakkafrost P/F	3.068.391
2.074	Adyen NV	3.049.926
6.119	Elevance Health Inc	3.017.676
176.596	3i Group Plc	2.681.969
23.084	Novo Nordisk A/S Class B	2.581.657
9.835	Estee Lauder Cos Inc Class A	2.485.593
15.712	Marsh & McLennan Cos Inc	2.485.116
13.741	Zoetis Inc Class A	2.418.781
6.597	Adobe Inc	2.223.073
7.571	Moody's Corp	2.198.641
8.147	Danaher Corp	2.146.976
65.138	HelloFresh SE	1.938.207
9.081	Veeva Systems Inc Class A	1.772.616
1.749	Partners Group Holding AG	1.670.019



## High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
22.695.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	21.990.600
19.290.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.25%, 15/04/2030	18.575.825
17.605.000	Condor Merger Sub Inc, 7.38%, 15/02/2030	17.605.000
20.805.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	17.451.349
17.580.000	Minerva Merger Sub Inc, 6.50%, 15/02/2030	17.339.478
12.105.000	Chart Industries Inc, 7.50%, 01/01/2030	11.942.914
11.275.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029	10.133.063
10.195.000	Southwestern Energy Co, 4.75%, 01/02/2032	10.084.655
9.885.000	Consensus Cloud Solutions Inc, 6.50%, 15/10/2028	9.780.614
11.555.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc, 5.25%, 15/08/2027	9.767.931
9.800.000	SPX FLOW Inc, 8.75%, 01/04/2030	9.327.934
9.860.000	Entegris Escrow Corp, 5.95%, 15/06/2030	8.956.035
7.670.000	Occidental Petroleum Corp, 6.13%, 01/01/2031	8.735.956
8.795.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc, 6.63%, 01/03/2030	8.719.643
8.700.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 6.38%, 01/09/2029	8.603.243
9.180.000	Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028	8.347.982
8.420.000	Vistra Operations Co LLC, 5.50%, 01/09/2026	8.299.279
8.385.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc, 7.88%, 01/05/2027	8.240.587
9.227.940	Team Health Holdings Inc, 9.57%, 02/03/2027	8.223.547
8.590.000	Centene Corp, 3.38%, 15/02/2030	8.202.088

## High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
34.080.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031	32.170.694
23.167.717	Great Outdoors Group LLC, 4.50%, 06/03/2028	23.149.050
21.365.000	Imola Merger Corp, 4.75%, 15/05/2029	20.014.619
19.495.000	Aramark Services Inc, 5.00%, 01/02/2028	19.023.725
22.010.000	CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030	16.938.213
16.845.000	KAR Auction Services Inc, 5.13%, 01/06/2025	16.665.225
17.519.000	CommScope Technologies LLC, 6.00%, 15/06/2025	16.049.974
15.835.000	Formula One Management Ltd, 3.50%, 01/02/2024	15.727.663
15.643.599	HUB International Ltd, 4.00%, 25/04/2025	15.539.684
16.625.000	Athenahealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030	14.957.263
14.625.000	CSC Holdings LLC, 7.50%, 01/04/2028	13.395.604
16.180.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.50%, 01/04/2028	13.117.813
14.005.000	Tenet Healthcare Corp, 6.13%, 01/10/2028	13.057.463
15.900.000	Altice France Holding SA, 6.00%, 15/02/2028	12.372.844
12.665.000	TransDigm Inc, 5.50%, 15/11/2027	12.216.487
12.240.000	SK Invictus Intermediate II Sarl, 5.00%, 30/10/2029	12.009.100
10.815.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC, 7.88%, 15/02/2025	11.158.231
12.145.000	Southwestern Energy Co, 4.75%, 01/02/2032	11.098.926
11.495.000	Arko Corp, 5.13%, 15/11/2029	10.602.760
13.595.000	Carvana Co, 5.50%, 15/04/2027	10.545.024

## InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
121.600	Sansan Inc	1.122.258
20.500	Square Enix Holdings Co Ltd	1.030.630
18.700	Ebara Corp	989.925
105.100	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	967.425
31.000	Silergy Corp	933.577
21.100	JMDC Inc	932.849
53.000	Global Unichip Corp	909.079
151.000	Unimicron Technology Corp	903.351
10.621	Kakao Corp	893.515
46.000	Phision Electronic Corp	843.280
29.900	Dexerials Corp	816.324
89.000	Elite Material Co Ltd	815.912
110.200	Hongfa Technology Co Ltd Class A	813.486
22.000	eMemory Technology Inc	802.725
107.000	Chroma ATE Inc	761.461
33.700	Meituan Class B	754.430
9.900	Rohm Co Ltd	746.795
55.000	Jentech Precision Industrial Co Ltd	739.490
21.800	Harmonic Drive Systems Inc	713.699
11.941	Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd Class A	666.890
29.900	Minebea Mitsumi Inc	649.981
58.100	CyberAgent Inc	605.941
21.690	Kanzhun Ltd ADR	568.003
69.000	Accton Technology Corp	561.470
2.163	LG Innotek Co Ltd	559.747
25.798	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	538.954
5.656	Sea Ltd ADR	527.835
163.000	Ennostar Inc	519.564
35.000	Yageo Corp	492.744
28.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	476.690
100.400	FPT Corp	473.808
32.000	Realtek Semiconductor Corp	460.820
1.800	Disco Corp	439.795
4.050	Tata Elxsi Ltd	402.762
4.969	SK Hynix Inc	389.328
103.900	Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A	376.685
18.489	UPI Semiconductor Corp	368.481
11.237	Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A	346.846
101.400	Longshine Technology Co Ltd Class A	339.059
28.000	Allied Supreme Corp	337.692
20.252	Tech Mahindra Ltd	337.246
58.000	E Ink Holdings Inc	326.896

## InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
15.000	Silergy Corp	1.230.267
47.763	UPI Semiconductor Corp	1.031.967
162.000	E Ink Holdings Inc	982.874
117.000	Gudeng Precision Industrial Co Ltd	943.210
53.000	Global Unichip Corp	938.141
155.000	Unimicron Technology Corp	822.937
16.600	JMDC Inc	819.449
191.000	Gigabyte Technology Co Ltd	769.211
18.700	Ebara Corp	724.569
25.000	MediaTek Inc	721.976
4.458	HYBE Co Ltd	692.969
196.000	Episil Technologies Inc	682.572
5.870	Fabrinet	666.605
31.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	651.651
11.853	Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd Class A	641.005
64.500	Sansan Inc	619.504
46.000	Phision Electronics Corp	604.144
58.500	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	602.425
1.864	ASM International NV	573.797
69.000	Accton Technology Corp	573.213
6.935	Sea Ltd ADR	566.902
24.300	JSR Corp	545.129
12.900	Ibiden Co Ltd	528.217
7.000	Rohm Co Ltd	519.773
38.771	Tech Mahindra Ltd	511.106
10.621	Kakao Corp	508.011
3.176	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	497.979
6.200	Omron Corp	494.335
361.833	Zomato Ltd	486.261
10.000	eMemory Technology Inc	485.660
11.600	Square Enix Holdings Co Ltd	484.408
29.900	MINEBEA MITSUMI Inc	478.516
58.606	Navitas Semiconductor Corp	477.985
6.100	Sysmex Corp	477.783
75.000	Amazing Microelectronic Corp	474.247
5.860	SK Hynix Inc	464.754
141.400	AEM Holdings Ltd	454.962
17.019	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	447.401
24.200	Meituan Class B	439.415
17.000	Dexerials Corp	426.831
17.800	Fuji Corp	411.702
163.000	Ennostar Inc	409.311
6.989	Lattice Semiconductor Corp	385.382
9.482	STMicroelectronics NV	374.962
35.470	Montage Technology Co Ltd Class A	356.448

## InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
32.000	Realtek Semiconductor Corp	352.297
61.000	Chroma ATE Inc	351.091
11.446	Rambus Inc	350.376
54.600	Rakuten Group Inc	344.165
13.198	Giantstep Inc	341.634

## Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten JPY
2.108.700	Concordia Financial Group Ltd	1.009.906.709
173.000	Pilot Corp	855.735.559
1.140.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	771.289.684
711.000	Ricoh Co Ltd	732.935.619
275.000	USS Co Ltd	676.342.283
123.000	Yamaha Corp	670.947.817
137.900	Shoei Co Ltd	662.256.034
147.000	Okinawa Cellular Telephone Co	645.226.668
360.000	BeNext-Yumeshin Group Co	612.795.389
330.800	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	578.905.014
196.000	NGK Spark Plug Co Ltd	530.449.516
115.000	Hokkoku Financial Holdings Inc	520.520.997
212.000	Snow Peak Inc	516.819.665
477.900	Amada Co Ltd	502.187.703
200.000	Resorttrust Inc	469.826.038
137.000	Nifco Inc	451.493.829
48.000	Kohoku Kogyo Co Ltd	373.865.210
123.000	Nakanishi Inc	338.000.872
52.900	As One Corp	336.550.065
300.000	Daiwa Industries Ltd	334.881.458
75.000	JSB Co Ltd	317.459.612
64.500	Zenkoku Hoshu Co Ltd	313.596.426
156.000	Yokogawa Electric Corp	312.603.460
85.000	MISUMI Group Inc	301.996.195
248.600	Yamanashi Chuo Bank Ltd	284.304.541
180.000	Direct Marketing MiX Inc	281.229.653
73.000	JSR Corp	251.358.291
102.000	Kansai Paint Co Ltd	236.185.538
74.300	MEC Co Ltd	232.040.894
50.000	Otsuka Corp	228.928.682
64.000	BML Inc	220.518.930
51.000	Heiwa Real Estate Co Ltd	205.868.454
145.300	Daiei Kankyo Co Ltd	196.155.000
47.000	Justsystems Corp	189.348.603
59.000	TKC Corp	188.729.220
40.800	Daiseki Co Ltd	185.741.102
65.000	PR Times Inc	184.099.418

## Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse JPY
1.668.700	Concordia Financial Group Ltd	750.752.620
397.900	Amada Co Ltd	414.336.128
166.000	Snow Peak Inc	411.882.789
90.000	Otsuka Corp	399.352.937
331.000	Ricoh Co Ltd	349.078.891
150.500	Daibiru Corp	331.712.879
57.900	Shoei Co Ltd	292.675.063
70.000	MISUMI Group Inc	279.322.052
81.000	JSR Corp	273.839.179
59.500	Zenkoku Hoshō Co Ltd	272.960.709
58.800	Daiseki Co Ltd	264.120.688
101.300	MEC Co Ltd	256.915.644
100.000	ValueCommerce Co Ltd	241.064.613
157.000	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	240.010.564
103.000	Yokogawa Electric Corp	231.175.530
35.000	Fujimi Inc	217.141.326
55.000	Heiwa Real Estate Co Ltd	213.557.709
37.000	Yamaha Corp	200.831.692
53.400	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	195.952.298
29.000	As One Corp	191.513.995
73.000	NGK Spark Plug Co Ltd	191.486.301
87.000	Kansai Paint Co Ltd	155.971.518
95.500	Direct Marketing MiX Inc	152.250.592
220.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	145.952.993
18.000	Kohoku Kogyo Co Ltd	143.125.257
75.000	NEC Networks & System Integration Corp	132.236.791
22.000	JMDC Inc	130.514.661
159.300	ExaWizards Inc	120.770.044
52.000	SB Technology Corp	111.738.120
47.300	HPC Systems Inc	108.656.099
2.700	BayCurrent Consulting Inc	106.375.833
127.200	AB&Company Co Ltd	100.608.703
45.000	PR Times Inc	99.286.786
54.388	Fast Fitness Japan Inc	96.825.741

## Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
4.000.000	Finland T-Bill, 0.00%, 14/08/2023	3.926.466
3.500.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023	3.499.697
2.000.000	BNG Bank, 0.05%, 11/07/2023	1.972.400
2.000.000	Societe Generale SFH SA, 0.25%, 11/09/2023	1.963.850
2.000.000	Santander UK Plc, 0.38%, 20/09/2023	1.962.250
1.750.000	Lloyds Bank Plc, 4.88%, 13/01/2023	1.834.140
1.800.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.25%, 29/11/2022	1.811.436
1.665.000	Kreditanstalt Fuer Wiederaufbau, 0.13%, 07/06/2023	1.653.462
1.500.000	Erste Group Bank AG, 0.63%, 19/01/2023	1.513.437
1.500.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.63%, 28/11/2022	1.510.500
1.500.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 0.38%, 30/05/2023	1.488.570
1.500.000	Jyske Realkredit A/S, 0.25%, 01/07/2023	1.483.965
1.500.000	Commerzbank AG, 0.25%, 13/09/2023	1.473.960
1.500.000	Cie de Financement Foncier SA, 0.33%, 12/09/2023	1.473.750
1.500.000	Bank of Nova Scotia, 0.38%, 23/10/2023	1.468.965
1.200.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 20/04/2023	1.189.190
1.200.000	Belfius Bank SA, 0.38%, 24/10/2023	1.174.500
1.000.000	UNEDIC ASSEO, 2.25%, 05/04/2023	1.023.720
1.000.000	Heta Asset Resolution AG, 2.38%, 13/12/2022	1.016.400
1.000.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.90%, 20/10/2023	1.011.030
1.000.000	ING Bank NV, 1.88%, 22/05/2023	1.008.630
1.000.000	Arkea Home Loans SFH SA, 2.38%, 11/07/2023	1.007.550
1.000.000	Bank of Montreal, 0.20%, 26/01/2023	1.003.410
1.000.000	Cie de Financement Foncier SA, 0.20%, 16/09/2022	1.003.390
1.000.000	Belfius Bank SA, 0.25%, 10/03/2022	1.000.150
1.000.000	AXA Bank Europe SCF, 0.38%, 23/03/2023	998.650
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 19/01/2023	998.566
1.000.000	BPCE SFH SA, 2.38%, 29/11/2023	997.100
1.000.000	DNB Boligkreditt AS, 0.25%, 18/04/2023	996.830
1.000.000	Dexia Credit Local SA, 0.25%, 01/06/2023	994.890
1.000.000	OP Mortgage Bank, 0.25%, 11/05/2023	994.270
1.000.000	National Bank of Canada, 0.00%, 29/09/2023	976.470
800.000	National Australia Bank Ltd, 1.88%, 13/01/2023	818.168
800.000	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV, 0.13%, 01/06/2023	793.616
724.000	European Stability Mechanism, 0.10%, 31/07/2023	716.524
700.000	Societe Generale SFH SA, 0.50%, 21/09/2022	703.570
600.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.13%, 22/09/2023	588.480



## Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
3.500.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023	3.475.153
1.800.000	Bank of Scotland Plc, 4.75%, 08/06/2022	1.830.996
1.750.000	Lloyds Bank Plc, 4.88%, 13/01/2023	1.782.585
1.500.000	ABN AMRO Bank NV, 3.50%, 21/09/2022	1.502.895
1.500.000	Erste Group Bank AG, 0.63%, 19/01/2023	1.497.570
1.200.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 16/06/2022	1.201.895
1.100.000	Societe Generale SFH SA, 0.25%, 11/09/2023	1.079.718
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 10/11/2022	1.000.494
1.000.000	Arkea Home Loans SFH SA, 0.63%, 30/09/2022	1.000.490
1.000.000	Cie de Financement Foncier SA, 0.20%, 16/09/2022	1.000.100
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 19/01/2023	998.373
1.000.000	BNG Bank N.V., 0.05%, 11/07/2023	986.020
800.000	Nationwide Building Society, 4.38%, 28/02/2022	801.080
800.000	National Australia Bank Ltd, 0.25%, 28/03/2022	800.536
750.000	Finland T-Bill, 0.00%, 14/08/2023	736.919
724.000	European Stability Mechanism, 0.10%, 31/07/2023	713.108
700.000	KBC Bank NV, 0.38%, 01/09/2022	703.199
700.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.00%, 25/07/2022	701.988
700.000	Belfius Bank SA, 0.25%, 10/03/2022	700.910
700.000	Santander UK Plc, 0.25%, 21/04/2022	700.784
700.000	Swedbank Hypotek AB, 0.38%, 11/03/2022	700.413
700.000	HSBC SFH France SA, 0.38%, 11/03/2022	700.252
665.000	Kreditanstalt Fuer Wiederaufbau, 0.13%, 07/06/2023	658.077
600.000	UBS AG, 4.00%, 08/04/2022	603.156
600.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.25%, 29/11/2022	603.006
600.000	Bank of Nova Scotia, 0.25%, 28/09/2022	602.610
500.000	Royal Bank of Canada, 0.88%, 17/06/2022	502.085
500.000	Societe Generale SFH SA, 0.50%, 21/09/2022	500.109
500.000	Cie de Financement Foncier SA, 0.63%, 10/02/2023	498.730
500.000	Commerzbank AG, 0.13%, 23/02/2023	497.875
500.000	Santander UK Plc, 0.38%, 20/09/2023	490.685
300.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.63%, 27/01/2022	300.219

## Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
260.799	Neuberger Berman Commodities Fund	3.200.000
1.600.000	Repsol International Finance BV, 4.50%, 25/03/2075	1.873.124
1.600.000	SES SA, 5.63%, 29/12/2049	1.820.937
1.600.000	Schaeffler AG, 3.38%, 12/10/2028	1.814.728
1.600.000	Loxam SAS, 4.50%, 15/02/2027	1.803.932
1.600.000	Telefonica Europe BV, 3.88%, 29/12/2049	1.787.097
1.600.000	TK Elevator Midco GmbH, 4.75%, 15/07/2027	1.780.222
1.600.000	Avantor Funding Inc, 3.88%, 15/07/2028	1.769.115
1.600.000	Gruenthal GmbH, 4.13%, 15/05/2028	1.752.770
1.600.000	Intrum AB, 3.50%, 15/07/2026	1.749.054
1.600.000	Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049	1.740.840
1.758.400	United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/05/2051	1.737.810
1.600.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4.38%, 09/05/2030	1.734.041
1.600.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025	1.729.872
1.600.000	Orano SA, 3.38%, 23/04/2026	1.699.006
1.600.000	Nidda Healthcare Holding GmbH, 3.50%, 30/09/2024	1.690.534
1.600.000	Sappi Papier Holding GmbH, 3.13%, 15/04/2026	1.686.349
1.600.000	INEOS Finance Plc, 2.88%, 01/05/2026	1.684.902
1.600.000	Adient Global Holdings Ltd, 3.50%, 15/08/2024	1.677.633
1.600.000	Bayer AG, 5.38%, 25/03/2082	1.669.715
1.600.000	Lincoln Financing Sarl, 3.88%, 01/04/2024	1.649.160
1.600.000	Assemblin Financing AB, 5.00%, 15/05/2025	1.647.161
1.600.000	eircom Finance DAC, 1.75%, 01/11/2024	1.634.378
1.600.000	Telecom Italia SpA, 2.38%, 12/10/2027	1.621.327
1.600.000	Iliad Holding SASU, 5.63%, 15/10/2028	1.601.128
1.600.000	Prudential Financial Inc, 6.00%, 01/09/2052	1.600.000
1.600.000	Altice Financing SA, 2.25%, 15/01/2025	1.592.122
1.600.000	Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027	1.584.059
1.600.000	eG Global Finance Plc, 3.63%, 07/02/2024	1.582.306
36.800	Enbridge Inc	1.571.857
1.600.000	Belden Inc, 3.88%, 15/03/2028	1.555.978
1.600.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4.38%, 15/01/2028	1.532.952
1.600.000	United Group BV, 4.63%, 15/08/2028	1.504.785
1.600.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy, 3.63%, 04/02/2028	1.485.909
1.600.000	Emeria SASU, 3.38%, 31/03/2028	1.472.364
1.600.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 6.88%, 15/11/2026	1.468.133
1.600.000	Cellnex Finance Co SA, 1.50%, 08/06/2028	1.438.391
22.400	Kinetik Holdings Inc Class A	1.420.735
1.600.000	Dufry One BV, 3.38%, 15/04/2028	1.418.025
1.600.000	Altice Financing SA, 4.25%, 15/08/2029	1.409.386
1.600.000	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028	1.362.563
1.600.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081	1.329.385
1.406.717	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH, 6.00%, 30/07/2026	1.328.590
1.600.000	S.P.C.M. SA, 2.63%, 01/02/2029	1.306.822

## Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
1.600.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3.75%, 15/07/2026	1.274.781
1.600.000	IHO Verwaltungs GmbH, 3.88%, 15/05/2027	1.266.237
1.600.000	Faurecia SE, 2.38%, 15/06/2027	1.239.214
16.000	NextEra Energy Partners LP	1.228.908
1.600.000	Arena Luxembourg Finance Sarl, 1.88%, 01/02/2028	1.183.975
1.099.574	Diocle SpA, 3.88%, 30/06/2026	1.111.863
1.280.000	Ally Financial Inc, 4.70%, 29/12/2049	1.088.000
34.032	Williams Cos Inc	1.057.853
1.040.000	Bank of America Corp, 6.13%, 29/12/2049	1.040.000
104.000	Antero Midstream Corp	1.039.575
1.200.000	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/02/2052	1.012.491
16.000	TC Energy Corp	886.160

## Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
82.832	iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	7.288.992
622.222	Neuberger Berman China Bond Fund	5.920.000
2.800.000	SGL Carbon SE, 4.63%, 30/09/2024	3.066.618
3.200.000	Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078	3.059.200
2.400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4.50%, 01/03/2025	2.760.482
2.400.000	Schenck Process Holding GmbH, 5.38%, 15/06/2023	2.637.633
2.517.000	Summer BidCo BV, 9.00%, 15/11/2025	2.580.828
3.200.000	HSBC Holdings Plc, 4.70%, 29/12/2049	2.544.736
2.400.000	DKT Finance ApS, 7.00%, 17/06/2023	2.492.365
3.200.000	BNP Paribas SA, 4.50%, 29/12/2049	2.461.984
72.112	Williams Cos Inc	2.437.404
2.505.600	United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/05/2051	2.279.776
1.920.000	Paprec Holding SA, 4.00%, 31/03/2025	2.186.893
3.200.000	Barclays Plc, 4.38%, 29/12/2049	2.130.944
2.640.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2051	2.037.492
1.840.000	Motion Bondco DAC, 4.50%, 15/11/2027	1.985.710
2.000.000	House of Finance NV, 4.38%, 15/07/2026	1.942.672
28.976	Dominion Energy Inc	1.867.466
1.600.000	CMA CGM SA, 7.50%, 15/01/2026	1.827.455
1.600.000	Rolls-Royce Plc, 4.63%, 16/02/2026	1.825.276
1.600.000	Electricite de France SA, 6.00%, 29/12/2049	1.809.300
1.600.000	International Game Technology Plc, 3.50%, 15/06/2026	1.776.258
1.600.000	Vivion Investments Sarl, 3.50%, 01/11/2025	1.702.354
1.600.000	Lincoln Financing Sarl, 6.01%, 01/04/2024	1.687.600
1.600.000	NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073	1.686.055
24.000	Targa Resources Corp	1.667.230
1.600.000	Repsol International Finance BV, 4.50%, 25/03/2075	1.650.286
1.600.000	Orano SA, 3.38%, 23/04/2026	1.644.318
1.600.000	TK Elevator Midco GmbH, 7.04%, 15/07/2027	1.638.634
1.600.000	eircom Finance DAC, 1.75%, 01/11/2024	1.635.377
1.600.000	IPD 3 BV, 5.50%, 01/12/2025	1.630.662
1.600.000	Ontex Group NV, 3.50%, 15/07/2026	1.623.901
1.600.000	Encore Capital Group Inc, 6.54%, 15/01/2028	1.606.696
10.400	Cheniere Energy Inc	1.602.457
1.600.000	SES SA, 5.63%, 29/12/2049	1.588.961
1.600.000	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.00%, 23/04/2075	1.582.960
1.600.000	Prudential Financial Inc, 6.00%, 01/09/2052	1.577.032
1.600.000	Altice Financing SA, 2.25%, 15/01/2025	1.565.441
1.600.000	Loxam SAS, 4.50%, 15/02/2027	1.554.474
1.600.000	Belden Inc, 3.88%, 15/03/2028	1.548.521
1.600.000	Summer BC Holdco B Sarl, 5.75%, 31/10/2026	1.541.616
1.600.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 6.88%, 15/11/2026	1.514.786
1.600.000	Nidda Healthcare Holding GmbH, 3.50%, 30/09/2024	1.514.190
1.600.000	PCF GmbH, 4.75%, 15/04/2026	1.510.063

## Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.600.000	Volkswagen International Finance NV, 4.63%, 29/12/2049	1.509.172
1.600.000	eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025	1.502.475
1.600.000	Maxeda DIY Holding BV, 5.88%, 01/10/2026	1.497.106
212.864	iShares MSCI India UCITS ETF	1.490.645
1.600.000	Schaeffler AG, 3.38%, 12/10/2028	1.484.952
1.600.000	Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049	1.475.738
1.600.000	Sappi Papier Holding GmbH, 3.13%, 15/04/2026	1.464.049
1.600.000	BP Capital Markets Plc, 3.63%, 29/12/2049	1.463.751
1.600.000	Summit Properties Ltd, 2.00%, 31/01/2025	1.461.512
1.600.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.13%, 29/12/2049	1.459.053
9.472	Sempra Energy	1.449.295
1.360.000	United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 15/08/2043	1.445.340
1.600.000	Allwyn International AS, 3.88%, 15/02/2027	1.444.780
1.600.000	IHO Verwaltungs GmbH, 3.88%, 15/05/2027	1.431.508
1.360.000	United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 15/02/2044	1.399.242
1.600.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3.75%, 15/07/2026	1.398.197

## Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
190.473	MP Materials Corp	6.430.381
10.432	Monolithic Power Systems Inc	4.344.481
27.681	Ambarella Inc	2.510.373
11.963	Autodesk Inc	2.485.531
43.624	Lattice Semiconductor Corp	2.418.333
13.506	Prologis Inc	2.187.485
5.826	Deere & Co	2.134.076
11.970	Analog Devices Inc	2.008.975
25.731	Micron Technology Inc	1.967.893
26.814	Trimble Inc	1.927.313
15.772	TE Connectivity Ltd	1.883.973
6.925	ANSYS Inc	1.870.732
22.625	Advanced Micro Devices Inc	1.870.592
61.293	Gentex Corp	1.720.240
9.404	Keysight Technologies Inc	1.493.086
12.060	Aptiv Plc	1.477.351
16.693	Amphenol Corp Class A	1.244.758
22.700	StarPower Semiconductor Ltd Class A	1.244.692
3.882	Linde Plc	1.194.914
4.407	Air Products & Chemicals Inc	1.149.172
41.522	Rambus Inc	1.101.753
8.031	Applied Materials Inc	1.095.969
1.818	ASML Holding NV	1.067.152
48.200	Baidu Inc Class A	980.706
17.027	Altair Engineering Inc Class A	939.980
61.386	ChargePoint Holdings Inc	931.072
4.278	Tesla Inc	911.109
47.777	NIO Inc ADR	892.867
4.927	NVIDIA Corp	848.598
5.281	Cadence Design Systems Inc	836.433
13.861	Globalfoundries Inc	818.863
3.621	Zscaler Inc	778.839
3.926	NXP Semiconductors NV	749.148
18.418	General Motors Co	745.932
1.364	Lam Research Corp	721.014
6.152	Qorvo Inc	665.598

## Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
204.284	MP Materials Corp	8.670.271
17.926	Deere & Co	6.773.229
25.302	Analog Devices Inc	4.081.380
21.797	Texas Instruments Inc	3.757.538
53.927	Micron Technology Inc	3.380.275
14.914	Caterpillar Inc	3.126.674
14.803	Autodesk Inc	2.995.649
14.229	NXP Semiconductors NV	2.613.846
37.250	Lattice Semiconductor Corp	2.141.086
22.292	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	2.023.973
14.881	T-Mobile US Inc	2.013.275
26.024	Trimble Inc	1.681.829
6.203	Coherent Inc	1.660.666
5.346	Linde Plc	1.644.130
32.420	II-VI Inc	1.640.796
52.749	Uber Technologies Inc	1.615.654
52.335	Rambus Inc	1.579.121
2.880	Monolithic Power Systems Inc	1.496.345
19.645	ON Semiconductor Corp	1.319.525
37.693	Coherent Corp	1.252.330
61.194	First Quantum Minerals Ltd	1.199.688
77.360	Alibaba Group Holding Ltd	1.026.703
13.645	Amphenol Corp Class A	976.404
16.230	BE Semiconductor Industries NV	952.389
7.465	Qorvo Inc	912.600
10.340	Ambarella Inc	839.426
6.783	Visteon Corp	780.109
3.026	Air Products & Chemicals Inc	728.284
12.955	Sensata Technologies Holding Plc	716.557

## Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
80.744	Planet Labs PBC	397.879
1.008	Teledyne Technologies Inc	390.662
77.425	Rocket Lab USA Inc	374.753
3.107	Airbus SE	335.437
2.266	Zscaler Inc	325.232
36.676	Eutelsat Communications SA	319.720
5.534	Intellian Technologies Inc	304.956
108.200	Singapore Technologies Engineering Ltd	300.173
1.328	Motorola Solutions Inc	292.094
1.968	CrowdStrike Holdings Inc Class A	292.042
21.156	Kratos Defense & Security Solutions Inc	288.096
3.011	Raytheon Technologies Corp	273.717
996	Palo Alto Networks Inc	253.224
2.065	Thales SA	252.899
3.023	Advanced Micro Devices Inc	251.330
4.016	Trimble Inc	250.812
2.421	Leidos Holdings Inc	243.627
1.030	L3Harris Technologies Inc	239.229
406	TransDigm Group Inc	234.129
1.704	QUALCOMM Inc	228.578
631	Deere & Co	228.018
2.184	Safran SA	221.630
776	CACI International Inc Class A	213.239
493	ServiceNow Inc	209.669
1.140	Amazon.com Inc	197.885
20.582	BAE Systems Plc	187.005
1.156	NVIDIA Corp	186.894
2.355	Moog Inc Class A	184.215
709	Microsoft Corp	180.246
6.951	Uber Technologies Inc	170.042
46.800	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	167.415
4.168	Dassault Systemes SE	166.655
2.898	Ball Corp	158.486
33.308	Universal Microwave Technology Inc	155.984
4.332	Mynaric AG	152.252
7.662	Smiths Group Plc	149.384
964	Keysight Technologies Inc	144.879
1.269	Arista Networks Inc	131.382
1.396	Okta Inc Class A	129.094
955	Jacobs Engineering Group Inc	124.983
24.600	Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A	120.196
232	ASML Holding NV	117.555
811	Snowflake Inc Class A	115.310
4.031	Maxar Technologies Inc	111.797
2.500	Tencent Holdings Ltd	110.474



## Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.030	L3Harris Technologies Inc	216.886
493	ServiceNow Inc	203.079
4.168	Dassault Systemes SE	152.682
738	Zscaler Inc	112.850
1.396	Okta Inc Class A	95.700
16.267	Planet Labs PBC	93.959
2.500	Tencent Holdings Ltd	93.931
4.031	Maxar Technologies Inc	93.223
4.332	Mynaric AG	79.304
6.936	Kratos Defense & Security Solutions Inc	73.804
9.195	SES SA Class A	71.081
540	Alphabet Inc Class A	63.741
78	Palo Alto Networks Inc	37.810
292	Arista Networks Inc	34.106
190	CrowdStrike Holdings Inc Class A	33.276
204	Snowflake Inc Class A	31.800
5.205	Rocket Lab USA Inc	31.489
227	Thales SA	28.371
260	Advanced Micro Devices Inc	25.638
228	Airbus SE	22.643
147	NVIDIA Corp	22.145
4.700	Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A	21.100
200	Safran SA	20.587
319	Trimble Inc	18.433
188	Raytheon Technologies Corp	17.976

## Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
53.460.000	Angolan Government International Bond, 8.25%, 09/05/2028	52.457.721
52.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/05/2023	50.891.176
43.200.000	1MDB Global Investments Ltd, 4.40%, 09/03/2023	41.738.000
31.400.000	JP Morgan Structured Product, 3.82%, 29/12/2022	35.901.189
31.971.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 16/11/2027	31.806.989
39.598.882	Ecuador Government International Bond, 5.50%, 31/07/2030	30.971.049
30.439.000	First Abu Dhabi Bank PJSC, 5.13%, 13/10/2027	30.226.231
29.086.000	Korea National Oil Corp, 1.75%, 18/04/2025	29.047.897
30.361.000	Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027	28.225.825
27.333.000	Corp Andina de Fomento, 2.25%, 08/02/2027	27.218.748
22.440.000	Egypt Government International Bond, 4.75%, 11/04/2025	24.348.520
25.331.827	Ivory Coast Government International Bond, 5.75%, 31/12/2032	23.378.548
21.984.000	Airport Authority, 1.75%, 12/01/2027	21.875.399
20.791.000	Chile Government International Bond, 2.75%, 31/01/2027	20.778.525
20.828.000	Emirates NBD Bank PJSC, 5.63%, 21/10/2027	20.720.736
24.934.000	Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030	20.572.680
19.430.000	BSF Finance, 5.50%, 23/11/2027	19.369.398
17.918.000	SNB Sukuk Ltd, 2.34%, 19/01/2027	17.918.000
17.240.000	Indonesia Government International Bond, 1.75%, 24/04/2025	16.654.962
17.100.000	Romania Government Bond, 3.00%, 27/02/2027	16.470.221
16.300.000	Ecopetrol SA, 5.38%, 26/06/2026	15.721.650
15.239.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais, 5.33%, 15/02/2028	15.696.170
23.471.958	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd, 0.00%, 05/06/2034	15.667.532
15.584.000	DIB Sukuk Ltd, 5.49%, 30/11/2027	15.588.360
16.000.000	Romanian Government International Bond, 2.88%, 26/05/2028	14.829.711
14.815.000	CMHI Finance BVI Co Ltd, 4.00%, 01/06/2027	14.810.407
14.741.000	DIB Sukuk Ltd, 2.74%, 16/02/2027	14.724.500
14.708.000	MDGH GMTN RSC Ltd, 3.00%, 28/03/2027	14.647.109
15.171.109	Honduras Government International Bond, 7.50%, 15/03/2024	14.604.335
14.756.000	Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.95%, 24/02/2027	14.552.669
20.927.000	Egypt Government International Bond, 4.75%, 16/04/2026	14.443.352
13.740.000	Serbia International Bond, 3.13%, 15/05/2027	13.998.255
18.190.000	Bahamas Government International Bond, 6.00%, 21/11/2028	13.885.875
15.000.000	Ivory Coast Government International Bond, 5.25%, 22/03/2030	13.591.507
12.992.000	Banco Bradesco SA, 4.38%, 18/03/2027	12.982.591
12.926.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC, 3.50%, 31/03/2027	12.897.806

## Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
51.510.000	Costa Rica Government International Bond, 4.25%, 26/01/2023	52.281.338
39.000.000	Turkey Government International Bond, 7.25%, 23/12/2023	39.140.603
38.150.000	Turkey Government International Bond, 6.35%, 10/08/2024	36.337.875
47.700.000	Ghana Government International Bond, 8.13%, 18/01/2026	33.754.049
32.561.000	QNB Finansbank AS, 6.88%, 07/09/2024	32.889.709
32.500.000	China Construction Bank Corp, 1.00%, 04/08/2023	31.716.569
33.000.000	Abu Dhabi Government International Bond, 2.13%, 30/09/2024	31.663.500
27.300.000	Peruvian Government International Bond, 7.35%, 21/07/2025	30.278.200
29.000.000	China Minmetals Corp, 3.75%, 29/12/2049	29.020.350
27.791.000	Turkey Government International Bond, 5.60%, 14/11/2024	25.719.990
22.000.000	Turkey Government International Bond, 5.75%, 22/03/2024	21.065.000
18.540.000	Tecpetrol SA, 4.88%, 12/12/2022	18.726.320
19.000.000	Oman Government International Bond, 5.38%, 08/03/2027	18.682.500
17.000.000	Republic of Azerbaijan International Bond, 4.75%, 18/03/2024	17.274.940
17.290.000	Turkey Government International Bond, 6.38%, 14/10/2025	15.903.250
15.000.000	Republic of South Africa Government International Bond, 5.88%, 16/09/2025	15.797.500
16.367.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS, 5.13%, 22/06/2026	15.633.407
16.000.000	Costa Rica Government International Bond, 4.38%, 30/04/2025	15.486.408
15.000.000	Oman Government International Bond, 4.13%, 17/01/2023	15.189.750
20.927.000	Arab Republic of Egypt, 3.88%, 16/02/2026	13.989.700
15.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 1.45%, 08/01/2026	13.794.000
14.000.000	Abu Dhabi Government International Bond, 2.50%, 16/04/2025	13.475.000
15.000.000	Qatar Energy, 1.38%, 12/09/2026	13.446.250
13.289.000	Egypt Government International Bond, 5.25%, 06/10/2025	12.890.330
36.851.506	Russian Foreign Bond - Eurobond, 7.50%, 31/03/2030	12.846.174
12.800.000	Minsheng Hong Kong International Leasing Ltd Via Landmark Funding 2019 Ltd, 4.50%, 26/03/2022	12.736.000
12.400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.00%, 29/12/2049	12.262.293
12.000.000	Egypt Government International Bond, 5.88%, 11/06/2025	12.189.837

## Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
8.845.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	8.564.575
7.460.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 8.00%, 15/01/2027	7.148.500
5.525.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023	5.399.125
5.635.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023	5.398.151
6.015.000	Buckeye Partners LP, 4.13%, 01/12/2027	5.323.275
5.295.000	AssuredPartners Inc, 7.00%, 15/08/2025	5.123.075
4.965.000	XHR LP, 6.38%, 15/08/2025	5.095.654
4.480.000	Southwestern Energy Co, 5.70%, 23/01/2025	4.669.419
4.728.935	Team Health Holdings Inc, 6.78%, 02/03/2027	4.642.714
4.315.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 6.50%, 01/10/2025	4.217.188
4.245.000	Hanesbrands Inc, 4.63%, 15/05/2024	4.190.450
4.240.000	Medline Borrower LP, 3.80%, 23/10/2028	4.084.225
4.255.000	Standard Industries Inc, 5.00%, 15/02/2027	3.950.338
4.255.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc, 3.38%, 15/01/2026	3.854.876
4.130.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 5.25%, 01/08/2026	3.831.769
3.760.000	Avient Corp, 5.75%, 15/05/2025	3.680.188
3.705.000	Lindblad Expeditions LLC, 6.75%, 15/02/2027	3.577.925
3.605.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 7.00%, 01/11/2026	3.545.632
3.825.000	VistaJet Malta Finance Plc/XO Management Holding Inc, 7.88%, 01/05/2027	3.530.227
3.580.000	NuStar Logistics LP, 5.75%, 01/10/2025	3.466.619

## Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
9.420.000	Buckeye Partners LP, 4.35%, 15/10/2024	9.156.487
8.155.000	KAR Auction Services Inc, 5.13%, 01/06/2025	8.143.713
8.030.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC, 7.88%, 15/02/2025	8.019.098
7.715.000	Stevens Holding Co Inc, 6.13%, 01/10/2026	7.880.975
7.725.000	Carvana Co, 5.63%, 01/10/2025	6.883.200
6.780.000	TK Elevator US Newco Inc, 5.25%, 15/07/2027	6.685.725
6.230.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 5.13%, 15/05/2024	6.230.463
6.445.000	CommScope Technologies LLC, 6.00%, 15/06/2025	5.591.038
5.304.757	Team Health Holdings Inc, 3.75%, 06/02/2024	5.218.535
5.415.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 6.50%, 01/10/2025	5.198.400
5.265.000	Live Nation Entertainment Inc, 4.88%, 01/11/2024	5.129.281
4.885.000	Cinemark USA Inc, 8.75%, 01/05/2025	5.104.825
4.890.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op, 5.50%, 01/05/2025	4.865.800
4.950.000	Mercer International Inc, 5.50%, 15/01/2026	4.842.900
4.620.000	Sprint LLC, 7.13%, 15/06/2024	4.829.723
6.505.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc, 4.50%, 15/09/2026	4.779.439
4.900.000	CommScope Inc, 6.00%, 01/03/2026	4.761.951
4.675.000	Six Flags Entertainment Corp, 4.88%, 31/07/2024	4.596.875
4.480.000	Southwestern Energy Co, 5.70%, 23/01/2025	4.536.000
4.425.000	Select Medical Corp, 6.25%, 15/08/2026	4.197.914
4.400.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	4.194.189
4.170.000	Hilton Domestic Operating Co Inc, 5.38%, 01/05/2025	4.170.374
4.230.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 7.75%, 15/10/2025	4.120.017
3.965.000	US Acute Care Solutions LLC, 6.38%, 01/03/2026	4.061.519
4.025.000	Presidio Holdings Inc, 4.88%, 01/02/2027	3.927.438
4.270.000	CD&R Smokey Buyer Inc, 6.75%, 15/07/2025	3.810.100
3.680.000	Spirit AeroSystems Inc, 5.50%, 15/01/2025	3.761.570
3.540.000	Aramark Services Inc, 5.00%, 01/04/2025	3.566.550

## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
1.858.720.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/04/2053	1.866.010.622
1.807.120.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2053	1.824.632.791
1.793.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2053	1.783.061.287
1.793.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2053	1.757.654.950
1.736.880.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 15/05/2042	1.674.663.544
1.621.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/03/2053	1.649.732.047
1.723.360.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/06/2053	1.611.053.497
1.554.800.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/02/2053	1.601.687.641
1.624.640.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2053	1.520.998.269
1.490.960.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2052	1.344.857.025
1.152.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/08/2022	1.149.349.755
1.212.240.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/07/2053	1.141.691.162
1.000.960.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2042	994.142.500
1.016.800.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2053	978.422.356
943.280.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/07/2053	915.021.247
960.560.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/08/2053	891.124.865
892.080.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	885.642.275
892.080.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2053	880.110.060
869.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 14/09/2053	857.840.679
889.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/08/2053	850.625.575
916.320.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2053	832.498.647
783.280.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/04/2053	799.109.506
839.440.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/10/2052	794.765.925
775.360.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/01/2053	771.486.947
777.520.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/08/2053	763.392.872
776.800.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/09/2053	738.590.700
724.640.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2042	728.146.962
731.360.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/09/2053	726.969.135
749.840.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/10/2053	726.367.040
748.480.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/11/2052	682.001.975
654.080.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/10/2052	656.064.084
694.880.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/11/2052	652.248.891
646.800.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/12/2052	621.970.538
678.560.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/12/2052	614.388.160
592.160.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/03/2053	612.545.997
624.320.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/11/2053	611.241.925
595.600.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2053	598.333.609
626.560.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/01/2053	594.549.569
653.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/12/2052	573.106.900
560.400.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2053	567.062.888
558.800.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2053	565.899.656
605.920.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/01/2053	557.954.937
568.320.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/01/2053	554.296.538
533.520.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/08/2053	541.500.922
551.360.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	541.404.266

## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
537.520.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	539.987.050
533.520.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/07/2052	539.285.106
540.480.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2053	538.586.925
532.800.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2053	530.171.800
519.280.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/09/2053	529.022.494
527.840.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2052	523.020.434
497.920.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2053	498.389.206
541.920.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/10/2053	496.838.025
499.040.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/10/2053	491.102.669
463.680.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/11/2053	442.760.588
450.080.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/12/2052	421.636.256
413.840.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2053	408.253.613
432.560.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2053	407.834.463
384.800.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2053	389.431.344
422.320.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/06/2053	388.792.109

## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.807.120.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2053	1.801.608.091
1.858.720.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/04/2053	1.798.329.053
1.793.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2053	1.761.016.900
1.793.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2053	1.685.703.319
1.621.280.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/03/2053	1.630.779.666
1.723.360.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/06/2053	1.627.960.003
1.736.880.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 15/05/2042	1.627.459.053
1.595.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/01/2053	1.616.693.044
1.554.800.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/02/2053	1.586.283.060
1.624.640.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2053	1.470.953.019
1.490.960.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2052	1.359.003.122
1.194.960.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/01/2053	1.253.174.844
1.212.240.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/07/2053	1.123.097.431
1.016.800.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/06/2053	989.169.538
1.000.960.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/05/2042	965.289.441
960.560.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/08/2053	912.236.013
943.280.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/07/2053	903.209.112
892.080.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2053	888.830.812
889.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/08/2053	879.594.328
892.080.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	877.560.753
869.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/09/2053	824.695.237
916.320.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2053	815.155.738
783.280.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/04/2053	782.910.300
777.520.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/08/2053	774.180.750
839.440.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/10/2052	764.190.413
724.640.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2042	716.078.925
776.800.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/09/2053	714.015.525
731.360.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/09/2053	710.127.828
749.840.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/10/2053	704.505.691
748.480.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/11/2052	656.567.688
678.560.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/12/2052	643.007.575
646.800.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/12/2052	642.825.781
654.080.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/10/2052	641.303.275
694.880.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/11/2052	629.076.641
592.160.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/03/2053	609.950.188
653.760.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/12/2052	600.769.275
624.320.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/11/2053	600.366.031
595.600.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2053	590.993.788
551.360.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	558.252.725
558.800.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2053	557.518.113
533.520.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/08/2053	544.695.525
533.520.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/07/2052	542.678.737
537.520.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	539.347.106
530.880.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/01/2053	538.870.078



## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
532.800.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2053	532.234.313
519.280.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/09/2053	523.298.200
527.840.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2052	518.515.563
540.480.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2053	513.393.156
497.920.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2053	503.287.213
541.920.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/10/2053	479.550.335
499.040.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/10/2053	477.227.737
450.080.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/12/2052	437.876.600
463.680.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/11/2053	434.648.600
413.840.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2053	402.361.662
432.560.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2053	399.160.456
394.080.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/01/2053	389.790.012
384.800.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2053	389.235.950
422.320.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/06/2053	377.153.937
461.040.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2051	371.057.064
362.000.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/12/2052	360.610.163
420.480.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/11/2053	359.894.028
354.000.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/02/2053	359.749.325
354.000.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/03/2053	359.428.937
353.680.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/08/2022	353.432.227
363.120.000	Ginnie Mae, 3.00%, 01/04/2053	352.572.478
359.600.000	Ginnie Mae, 4.50%, 01/12/2052	351.580.906
383.200.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/07/2053	350.952.106

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
2.893.250	Greenko Power II Ltd, 4.30%, 13/12/2028	2.755.706
2.090.000	CIFI Holdings Group Co Ltd, 5.95%, 20/10/2025	1.814.000
1.480.000	Network i2i Ltd, 5.65%, 29/12/2049	1.534.122
1.450.000	Mongolia Government International Bond, 4.45%, 07/07/2031	1.361.480
1.350.000	Fortune Star Bvi Ltd, 6.75%, 02/07/2023	1.357.360
1.400.000	Shui On Development Holding Ltd, 6.15%, 24/08/2024	1.315.113
1.229.825	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd, 6.75%, 24/04/2033	1.274.363
1.300.000	Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027	1.264.985
1.300.000	JSW Steel Ltd, 5.05%, 05/04/2032	1.212.760
1.250.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 3.75%, 30/03/2026	1.209.488
1.300.000	Sands China Ltd, 5.90%, 08/08/2028	1.158.038
1.200.000	Singapore Airlines Ltd, 3.38%, 19/01/2029	1.127.921
1.300.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd, 6.70%, 30/09/2024	1.109.600
1.100.000	CA Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026	1.101.275
1.100.000	Medco Oak Tree Pte Ltd, 7.38%, 14/05/2026	1.094.150
1.050.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	1.062.524
1.200.000	Lenovo Group Ltd, 3.42%, 02/11/2030	1.056.240
1.050.000	Globe Telecom Inc, 4.20%, 29/12/2049	1.055.175
1.163.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries, 4.50%, 14/07/2028	1.042.721
1.078.075	Continuum Energy Levanter Pte Ltd, 4.50%, 09/02/2027	1.019.973
1.561.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd, 5.20%, 12/01/2026	1.010.648
1.280.000	Logan Group Co Ltd, 5.25%, 23/02/2023	1.008.160
1.061.500	JSW Hydro Energy Ltd, 4.13%, 18/05/2031	998.051
1.000.000	Shriram Transport Finance Co Ltd, 4.15%, 18/07/2025	987.620
1.000.000	CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	982.860
1.000.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.63%, 17/07/2027	973.480
900.000	ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027	919.300
940.000	NWD Finance BVI Ltd, 4.13%, 29/12/2049	910.890
900.000	PCPD Capital Ltd, 5.13%, 18/06/2026	902.590
960.000	Bangkok Bank PCL, 3.73%, 25/09/2034	861.023
1.200.000	Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029	790.450
800.000	Kasikornbank PCL, 3.34%, 02/10/2031	741.530
740.000	FWD Group Ltd, 5.75%, 09/07/2024	733.950
1.000.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 2.70%, 13/01/2025	715.800
680.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024	705.212
1.100.000	China SCE Group Holdings Ltd, 7.00%, 02/05/2025	702.650
700.000	Bank of East Asia Ltd, 0.00%, 22/04/2032	698.130

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
2.248.250	Greenko Power II Ltd, 4.30%, 13/12/2028	1.806.694
1.850.000	Shui On Development Holding Ltd, 6.15%, 24/08/2024	1.522.973
1.750.000	Mongolia Government International Bond, 4.45%, 07/07/2031	1.370.877
1.150.000	Network i2i Ltd, 5.65%, 29/12/2049	1.070.332
1.350.000	Fortune Star Bvi Ltd, 6.75%, 02/07/2023	1.060.749
2.452.000	CIFI Holdings Group Co Ltd, 5.95%, 20/10/2025	1.030.660
1.150.000	CA Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026	1.019.950
1.000.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	983.629
900.000	Celestial Miles Ltd, 5.75%, 29/12/2049	903.345
909.906	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd, 6.75%, 24/04/2033	882.862
903.000	ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.45%, 24/01/2028	864.173
1.000.000	Lenovo Group Ltd, 3.42%, 02/11/2030	840.256
1.033.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries, 4.50%, 14/07/2028	835.757
900.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 3.75%, 30/03/2026	821.205
1.300.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd, 6.70%, 30/09/2024	759.137
770.000	Shriram Transport Finance Co Ltd, 5.10%, 16/07/2023	740.880
800.000	Singapore Airlines Ltd, 3.38%, 19/01/2029	724.973
675.000	Lenovo Group Ltd, 5.88%, 24/04/2025	702.038
690.000	FWD Group Ltd, 5.75%, 09/07/2024	683.825
700.000	Bank of East Asia Ltd, 0.00%, 22/04/2032	680.633
721.000	Globe Telecom Inc, 4.20%, 29/12/2049	678.490
690.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	670.935
703.000	China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024	662.710
700.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024	661.229
700.000	ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027	651.863
800.000	NWD Finance BVI Ltd, 4.13%, 29/12/2049	647.000
730.000	Elect Global Investments Ltd, 4.85%, 29/12/2049	624.393
750.000	CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	600.000
900.000	Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd, 4.95%, 12/08/2024	581.150
600.000	Medco Oak Tree Pte Ltd, 7.38%, 14/05/2026	569.756
1.000.000	Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029	528.624
800.000	Studio City Finance Ltd, 6.00%, 15/07/2025	525.110
600.000	Bangkok Bank PCL, 3.73%, 25/09/2034	523.304
700.000	JSW Steel Ltd, 5.05%, 05/04/2032	518.000
644.000	JSW Hydro Energy Ltd, 4.13%, 18/05/2031	517.114
641.063	Continuum Energy Levanter Pte Ltd, 4.50%, 09/02/2027	505.671
534.000	Saka Energi Indonesia PT, 4.45%, 05/05/2024	503.780
474.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.70%, 06/06/2032	487.628
1.000.000	Country Garden Holdings Co Ltd, 7.25%, 08/04/2026	480.995
500.000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd, 5.50%, 06/04/2025	470.000

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
1.375.000	Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030	1.203.580
1.093.000	TSMC Arizona Corp, 4.25%, 22/04/2032	1.071.758
1.175.000	Ivory Coast Government International Bond, 5.25%, 22/03/2030	1.067.714
1.000.000	1MDB Global Investments Ltd, 4.40%, 09/03/2023	1.001.500
959.000	Banco Bradesco SA, 4.38%, 18/03/2027	958.904
952.000	America Movil SAB de CV, 5.38%, 04/04/2032	933.000
1.000.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd, 2.25%, 23/04/2031	815.114
815.000	Compania Cervecerias Unidas SA, 3.35%, 19/01/2032	813.973
800.000	Shinhan Bank Co Ltd, 4.38%, 13/04/2032	797.871
762.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc, 5.75%, 01/04/2033	751.164
985.000	Wynn Macau Ltd, 5.63%, 26/08/2028	746.640
656.000	Colombia Government International Bond, 8.00%, 20/04/2033	650.424
639.000	Comision Federal de Electricidad, 4.69%, 15/05/2029	638.872
600.000	Cencosud SA, 4.38%, 17/07/2027	574.490
555.000	CT Trust, 5.13%, 03/02/2032	555.000
600.000	Lenovo Group Ltd, 3.42%, 02/11/2030	554.286
546.000	Natura &Co Luxembourg Holdings Sarl, 6.00%, 19/04/2029	542.162
540.000	Republic of South Africa Government International Bond, 7.30%, 20/04/2052	540.000
534.000	GCC SAB de CV, 3.61%, 20/04/2032	533.936
522.000	America Movil SAB de CV, 4.70%, 21/07/2032	521.379

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.600.000	Saudi Arabian Oil Co, 4.25%, 16/04/2039	1.352.140
1.250.000	Petroleos Mexicanos, 6.50%, 23/01/2029	1.027.169
1.000.000	1MDB Global Investments Ltd, 4.40%, 09/03/2023	1.005.100
900.000	Sasol Financing USA LLC, 5.88%, 27/03/2024	886.950
762.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc, 5.75%, 01/04/2033	721.085
710.000	Embraer Netherlands Finance BV, 6.95%, 17/01/2028	708.685
750.000	CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	654.538
640.000	JSW Steel Ltd, 5.95%, 18/04/2024	651.300
639.000	Comision Federal de Electricidad, 4.69%, 15/05/2029	638.042
597.000	QNB Finansbank AS, 6.88%, 07/09/2024	604.140
600.000	Banco Bradesco SA, 4.38%, 18/03/2027	594.400
742.000	Saudi Arabian Oil Co, 4.38%, 16/04/2049	578.760
600.000	Alsea SAB de CV, 7.75%, 14/12/2026	576.950
606.000	Banco de Credito del Peru SA, 3.13%, 01/07/2030	555.135
552.000	America Movil SAB de CV, 5.38%, 04/04/2032	533.740
520.000	Shinhan Bank Co Ltd, 4.00%, 23/04/2029	512.970
601.000	Geopark Ltd, 5.50%, 17/01/2027	509.310
650.000	Adani Electricity Mumbai Ltd, 3.95%, 12/02/2030	507.952
500.000	Kallpa Generacion SA, 4.13%, 16/08/2027	506.900
510.000	JBS Finance Luxembourg Sarl, 2.50%, 15/01/2027	503.982

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
6.770.000	Chile Government International Bond, 2.55%, 27/07/2033	5.683.057
5.483.000	Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045	5.151.668
5.032.000	Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048	4.752.268
17.183.136	Argentine Republic Government International Bond, 1.50%, 09/07/2035	4.536.690
5.013.000	Peruvian Government International Bond, 3.00%, 15/01/2034	4.502.345
4.185.000	Ivory Coast Government International Bond, 6.88%, 17/10/2040	4.176.715
4.773.000	Colombia Government International Bond, 3.00%, 30/01/2030	4.061.343
3.870.000	Republic of Uzbekistan International Bond, 4.75%, 20/02/2024	3.845.318
6.006.673	Ecuador Government International Bond, 2.50%, 31/07/2035	3.674.304
4.110.000	Republic of Armenia International Bond, 3.95%, 26/09/2029	3.593.047
3.230.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	3.242.945
3.586.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	3.182.763
2.990.000	Oman Government International Bond, 6.25%, 25/01/2031	3.076.503
3.233.000	Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030	2.938.642
3.360.000	Dominican Republic International Bond, 6.40%, 05/06/2049	2.908.911
3.219.000	Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033	2.893.197
3.208.000	Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034	2.861.127
3.090.000	Morocco Government International Bond, 5.50%, 11/12/2042	2.820.549
1.923.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	2.783.694
3.390.000	Morocco Government International Bond, 3.00%, 15/12/2032	2.753.775
3.279.000	Serbia International Bond, 2.05%, 23/09/2036	2.710.822
2.654.000	Angolan Government International Bond, 8.75%, 14/04/2032	2.636.555
2.850.000	Philippine Government International Bond, 0.70%, 03/02/2029	2.628.098
3.001.000	Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029	2.433.065
2.886.000	Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045	2.410.355
2.309.000	Hungary Government International Bond, 1.75%, 05/06/2035	2.394.706
2.527.000	Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027	2.377.152
2.840.000	Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047	2.370.677
2.100.000	Uruguay Government International Bond, 4.38%, 23/01/2031	2.279.980
2.422.000	Brazilian Government International Bond, 5.63%, 07/01/2041	2.240.939
1.960.000	Mexico Government International Bond, 3.38%, 23/02/2031	2.130.162
2.488.000	Ivory Coast Government International Bond, 6.63%, 22/03/2048	2.127.680
2.840.000	Ukraine Government International Bond, 6.88%, 21/05/2031	2.062.182

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.923.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	2.555.436
2.654.000	Angolan Government International Bond, 8.75%, 14/04/2032	2.323.155
1.722.000	Croatia Government International Bond, 1.13%, 04/03/2033	1.393.225
1.355.000	Croatia Government International Bond, 2.88%, 22/04/2032	1.366.871
1.480.000	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.15%, 14/01/2030	1.306.100
1.380.000	Mexico Government International Bond, 3.50%, 12/02/2034	1.207.916
1.291.000	Republic of South Africa Government International Bond, 7.30%, 20/04/2052	1.197.467
1.278.000	Costa Rica Government International Bond, 6.13%, 19/02/2031	1.196.464
1.526.000	Turkey Government International Bond, 6.00%, 14/01/2041	1.056.908
1.300.000	Gabon Government International Bond, 6.63%, 06/02/2031	1.027.390
1.510.000	Ghana Government International Bond, 8.13%, 18/01/2026	1.019.781
1.324.000	Republic of South Africa Government International Bond, 5.75%, 30/09/2049	996.601
1.020.000	Paraguay Government International Bond, 5.60%, 13/03/2048	930.342
1.260.000	Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045	871.099
990.000	Croatia Government International Bond, 1.13%, 19/06/2029	865.947
830.000	Bermuda Government International Bond, 4.75%, 15/02/2029	858.303
740.000	DP World Ltd, 6.85%, 02/07/2037	803.455
730.000	Indonesia Government International Bond, 3.75%, 14/06/2028	780.710
726.000	Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042	768.268
730.000	Turkey Government International Bond, 6.38%, 14/10/2025	690.995
750.000	Brazilian Government International Bond, 3.88%, 12/06/2030	689.063
710.000	DP World Crescent Ltd, 3.88%, 18/07/2029	672.725
584.000	Mongolia Government International Bond, 8.75%, 09/03/2024	595.978
850.000	Zambia Government International Bond, 8.97%, 30/07/2027	569.823
640.000	Croatia Government International Bond, 1.50%, 17/06/2031	568.766
648.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	561.450
534.000	Croatia Government International Bond, 2.75%, 27/01/2030	529.687
610.000	Ukraine Government International Bond, 6.88%, 21/05/2031	505.538
460.000	Paraguay Government International Bond, 6.10%, 11/08/2044	456.453
440.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC, 2.50%, 06/05/2031	389.950
400.000	Republic Of South Africa Government International Bond, 5.88%, 22/06/2030	383.416

## Systematic Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
4.516	Microsoft Corp	1.225.829
7.573	Apple Inc	1.147.581
1.711	Alphabet Inc Class A	1.037.768
1.136	Tesla Inc	830.539
41.057	AT&T Inc	808.466
8.660	Phillips 66	787.426
8.639	Marathon Petroleum Corp	768.799
20.159	Anglo American Plc	760.097
8.663	Merck & Co Inc	746.257
7.169	CVS Health Corp	733.318
13.774	TotalEnergies SE	729.831
4.842	AbbVie Inc	714.018
2.647	Cigna Corp	710.394
311	Booking Holdings Inc	662.966
1.961	Goldman Sachs Group Inc	650.053
12.231	Samsung Electronics Co Ltd	646.948
1.258	UnitedHealth Group Inc	643.082
2.249	Ameriprise Financial Inc	641.625
12.073	Citigroup Inc	634.927
4.328	3M Co	624.755



## Systematic Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
169.250	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	864.529
13.030	Vanguard FTSE Emerging Markets UCITS ETF	840.370
3.239	Microsoft Corp	809.773
5.682	Merck & Co Inc	563.819
4.036	3M Co	541.963
3.594	Apple Inc	538.271
2.766	Alphabet Inc Class A	504.913
2.503	Target Corp	480.057
1.398	Roche Holding AG	458.821
4.411	Prudential Financial Inc	448.036
1.364	Cigna Corp	435.042
4.160	Consolidated Edison Inc	409.067
3.519	Marathon Petroleum Corp	399.202
695	Thermo Fisher Scientific Inc	399.114
3.766	CVS Health Corp	379.058
196	Booking Holdings Inc	378.678
3.653	Phillips 66	372.958
8.570	Exelon Corp	359.962
2.258	AbbVie Inc	355.266
11.512	Intel Corp	353.966

## Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
21.000.000	BNP Paribas SA, 0.25%, 13/04/2027	20.587.900
17.000.000	Morgan Stanley, 1.75%, 30/01/2025	17.492.920
16.671.000	Westpac Securities NZ Ltd, 1.78%, 14/01/2026	16.671.000
18.067.000	Hellenic Republic Government Bond, 1.75%, 18/06/2032	15.872.388
14.296.000	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	13.921.197
12.800.000	European Union, 0.80%, 04/07/2025	12.792.064
12.400.000	BPCE SA, 0.38%, 02/02/2026	12.377.360
12.000.000	Bank of America Corp, 1.38%, 07/02/2025	12.186.000
12.201.000	Commerzbank AG, 0.10%, 11/09/2025	12.123.890
12.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.13%, 09/04/2025	11.982.000
11.500.000	Morgan Stanley, 1.38%, 27/10/2026	11.829.725
11.500.000	Holcim Finance Luxembourg SA, 1.50%, 06/04/2025	11.496.665
11.500.000	Morgan Stanley, 1.88%, 27/04/2027	10.985.625
11.262.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.65%, 16/07/2032	10.887.238
11.000.000	Goldman Sachs Group Inc, 1.38%, 15/05/2024	10.870.300
10.693.000	AMCO - Asset Management Co SpA, 1.38%, 27/01/2025	10.762.683
10.700.000	Athene Global Funding, 0.83%, 08/01/2027	10.700.000
10.390.000	Mulcair Securities No 3 DAC Series 3 Class A, 0.49%, 24/04/2065	10.345.261
10.300.000	Amadeus IT Group, 0.00%, 09/02/2023	10.300.103
10.000.000	AMCO - Asset Management Co SpA, 1.50%, 17/07/2023	10.227.000

## Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
20.928.311	Primrose Residential Series 2021-1 Class A, 2.75%, 24/03/2061	20.896.918
19.199.679	Sabadell Consumo 2 FDT Series 2 Class D, 6.89%, 24/12/2034	19.187.003
18.500.000	Wells Fargo & Co, 1.34%, 04/05/2025	18.080.415
17.000.000	Morgan Stanley, 1.75%, 30/01/2025	17.075.700
17.103.404	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	16.964.647
16.671.000	Westpac Securities NZ Ltd, 1.78%, 14/01/2026	16.483.881
14.000.000	BNP Paribas SA, 0.50%, 15/07/2025	14.090.990
14.000.000	Heathrow Funding Ltd, 1.88%, 23/05/2022	14.075.600
14.000.000	Bank of America Corp, 0.82%, 22/09/2026	13.915.513
14.000.000	Bank of America Corp, 1.38%, 07/02/2025	13.817.815
14.296.000	Spain Government Bond, 2.55%, 31/10/2032	13.534.774
13.016.000	Credito Valtellinese SpA, 2.00%, 27/11/2022	13.191.716
13.394.673	MIRAVET Sarl Series 2020-1 Class A, 0.49%, 26/05/2065	13.091.122
12.800.000	European Union, 0.80%, 04/07/2025	12.811.235
13.500.000	BNP Paribas SA, 0.25%, 13/04/2027	12.312.775
15.099.000	Hellenic Republic Government Bond, 1.75%, 18/06/2032	12.287.811
11.500.000	AMCO - Asset Management Co SpA, 1.50%, 17/07/2023	11.716.062
12.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.13%, 09/04/2025	11.590.800
11.199.750	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.40%, 15/05/2030	11.368.364
11.098.000	Islandsbanki HF, 1.13%, 19/01/2024	11.153.490

## Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
120.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/07/2022	119.792.770
120.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/11/2022	119.215.230
120.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/03/2023	118.241.262
115.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/06/2022	114.862.431
115.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/09/2022	114.543.123
115.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/02/2023	113.606.237
105.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/02/2023	103.674.094
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/06/2022	99.908.889
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/06/2022	99.906.250
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/06/2022	99.864.222
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/07/2022	99.845.694
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/09/2022	99.593.875
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/10/2022	99.538.133
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/10/2022	99.465.115
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/10/2022	99.431.686
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/10/2022	99.382.182
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 03/01/2023	98.984.538
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/01/2023	98.856.711
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/02/2023	98.759.986
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/02/2023	98.645.510
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/03/2023	98.604.340
98.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 15/09/2022	97.672.439
98.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/01/2023	96.918.619
95.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/06/2022	94.921.625
95.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/09/2022	94.738.156
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/05/2022	89.931.375
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/08/2022	89.782.331
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/12/2022	89.319.943
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/04/2023	88.673.009
85.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/05/2022	84.926.688
85.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/08/2022	84.772.778
85.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/12/2022	84.330.493
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/04/2022	79.967.500
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/04/2022	79.963.750
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/07/2022	79.828.789
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/08/2022	79.812.322
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 15/11/2022	79.418.987
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/03/2023	78.809.163
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/08/2022	74.801.906
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/12/2022	74.384.775
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/12/2022	74.313.531
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/12/2022	74.265.216
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/04/2022	69.980.575
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/05/2022	69.966.313
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/05/2022	69.948.375

## Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2022	69.869.430
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/08/2022	69.850.463
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/11/2022	69.468.560
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/01/2023	69.171.165
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/03/2023	68.960.487
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/03/2023	68.960.487
64.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/11/2022	63.544.434

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2022	69.987.356
274.862	Dr Ing hc F Porsche AG	25.043.835
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/07/2022	19.991.330
121.925.000	Egypt Treasury Bill, 0.00%, 11/10/2022	7.141.557
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/06/2022	999.911

## XXXXXXXXXXXX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
55.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/03/2023	54.471.918
52.775.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/09/2022	52.580.724
52.750.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/12/2022	52.298.091
467.348	Safran SA	49.800.112
47.560.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 15/09/2022	47.401.461
47.245.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/09/2022	47.117.249
47.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/12/2022	46.667.982
46.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/07/2022	45.981.021
47.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/06/2023	45.929.063
46.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/10/2022	45.800.828
46.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/01/2023	45.604.431
45.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 03/01/2023	44.610.727
45.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/12/2022	44.610.016
6.809.962	Deutsche Lufthansa AG	44.584.078
45.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/02/2023	44.533.100
2.692.965	Volvo AB Class B	44.328.706
43.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/11/2022	42.766.843
42.740.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/08/2022	42.657.793
330.954	Schneider Electric SE	42.553.898
3.459.757	Ryanair Holdings Plc	42.454.205

## XXXXXXXXXXXX - Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
432.782	Safran SA	46.850.007
6.207.866	Deutsche Lufthansa AG	41.695.638
2.419.065	Volvo AB Class B	40.411.003
1.092.091	Howmet Aerospace Inc	38.602.731
3.128.369	Ryanair Holdings Plc	38.524.589
290.704	Schneider Electric SE	37.981.146
2.159.445	Rexel SA	37.704.383
22.753.580	Melrose Industries Plc	34.862.843
315.776	Airbus SE	34.061.305
30.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/10/2022	29.997.779
220.440	Air Liquide SA	28.257.882
701.702	RWE AG	27.882.536
994.000	Daimler Truck Holding AG	27.531.547
4.445.359	Glencore Plc	24.840.149
904.282	Alfa Laval AB	24.492.301
762.985	Prysmian SpA	24.457.910
324.056	Otis Worldwide Corp	23.980.417
661.368	Cargotec Oyj Class B	23.875.574
23.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/07/2022	22.990.083
155.360	Koninklijke DSM NV	20.798.010

## US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
8.589	Microsoft Corp	2.283.511
12.707	Apple Inc	1.960.854
5.478	Alphabet Inc Class A	1.717.201
8.135	Amazon.com Inc	1.629.715
1.729	UnitedHealth Group Inc	863.032
1.541	Thermo Fisher Scientific Inc	847.555
4.608	Meta Platforms Inc Class A	825.824
4.675	Salesforce Inc	800.252
3.264	McDonald's Corp	796.207
2.118	S&P Global Inc	756.463
3.657	CME Group Inc Class A	734.446
1.542	ServiceNow Inc	716.538
5.289	JPMorgan Chase & Co	695.754
3.823	Workday Inc Class A	679.119
10.933	TJX Cos Inc	674.405
1.612	Adobe Inc	629.609
1.242	Costco Wholesale Corp	608.645
1.843	Mastercard Inc Class A	605.034
3.539	CDW Corp	600.172
3.667	Waste Management Inc	585.247
2.902	Visa Inc Class A	581.895
1.876	Home Depot Inc	563.653
15.099	Keurig Dr Pepper Inc	557.268
7.003	NextEra Energy Inc	554.614
5.057	NIKE Inc Class B	550.896
9.416	Apollo Global Management Inc	535.936
2.318	Union Pacific Corp	533.680
2.581	Equifax Inc	528.237
4.938	Medtronic Plc	484.046
1.458	SBA Communications Corp Class A	470.840
2.648	Johnson & Johnson	452.100
2.822	AbbVie Inc	411.722
2.859	TE Connectivity Ltd	361.762
14.031	Enterprise Products Partners LP	359.198
8.198	Boston Scientific Corp	357.263
7.177	Brookfield Asset Management Inc Class A	356.998
2.635	Walmart Inc	356.228
2.244	Analog Devices Inc	351.289
12.641	Paycor HCM Inc	349.053
3.138	Okta Inc Class A	323.621



## US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
11.868	Apollo Global Management Inc	685.849
5.697	JPMorgan Chase & Co	623.937
2.313	McDonald's Corp	586.946
6.270	Medtronic Plc	515.177
738	Thermo Fisher Scientific Inc	377.664
2.385	Workday Inc Class A	376.424
15.825	Enterprise Products Partners LP	371.551
7.766	Keurig Dr Pepper Inc	293.113
2.705	Ashland Inc	248.887
889	Air Products and Chemicals Inc	229.088
3.409	TJX Cos Inc	220.898
1.270	Waste Management Inc	205.065
1.399	Walmart Inc	196.720
5.153	Chewy Inc Class A	189.809
589	Home Depot Inc	180.104
2.201	Zendesk Inc	174.545
3.723	Match Group Inc	165.023
3.623	Brookfield Asset Management Inc Class A	159.745
8.638	Dun & Bradstreet Holdings Inc	147.206
820	Expedia Group Inc	144.543
2.011	Lamb Weston Holdings Inc	121.754
175	BlackRock Inc Class A	111.205
1.627	Citigroup Inc	110.584
1.234	NextEra Energy Inc	105.136
600	Johnson & Johnson	103.313
1.719	Anaplan Inc	99.914
554	CDW Corp	96.390

## US Equity Index PutWrite – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
90.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/06/2024	84.806.859
90.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.38%, 15/09/2024	83.931.680
86.400.000	United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/03/2024	83.238.219
87.100.000	United States Treasury Note/Bond, 1.00%, 15/12/2024	81.562.418
29.800.000	United States Treasury Note/Bond, 1.63%, 15/12/2022	29.949.484
26.800.000	United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/06/2023	26.409.125
25.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 15/03/2023	24.905.273
25.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.13%, 15/09/2023	24.620.117
21.100.000	United States Treasury Note/Bond, 0.13%, 15/12/2023	20.569.344
12.000.000	United States Treasury Note/Bond, 1.50%, 15/09/2022	12.100.313

Es gab keine Verkäufe im Geschäftsjahr.

## US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
413.128	Johnson & Johnson	72.463.498
471.374	Procter & Gamble Co	71.181.170
745.925	Exxon Mobil Corp	67.736.764
513.895	JPMorgan Chase & Co	65.146.317
1.683.547	Bank of America Corp	60.951.761
328.470	Chevron Corp	53.657.364
1.024.624	Pfizer Inc	51.907.886
973.629	Newmont Corp	51.135.636
714.277	Rio Tinto Plc ADR	49.405.094
533.390	Merck & Co Inc	48.683.199
602.577	General Electric Co	48.561.711
735.175	Mondelez International Inc Class A	47.268.009
193.602	Constellation Brands Inc Class A	46.528.259
267.806	PNC Financial Services Group Inc	45.652.225
609.271	Bristol-Myers Squibb Co	45.379.735
450.645	Raytheon Technologies Corp	43.642.066
137.503	Berkshire Hathaway Inc Class B	43.185.800
187.958	Cummins Inc	41.150.725
1.079.639	Delta Air Lines Inc	40.327.376
467.040	NextEra Energy Inc	40.178.593
254.977	Sempra Energy	39.838.476
1.184.626	Freeport-McMoRan Inc	38.168.766
736.827	Truist Financial Corp	38.114.239
1.012.253	Keurig Dr Pepper Inc	37.984.082
646.824	Mosaic Co	36.709.741
281.225	DTE Energy Co	34.670.906
319.360	Duke Energy Corp	33.406.843
122.581	Parker-Hannifin Corp	32.443.849
334.496	American Electric Power Co Inc	32.022.642
210.103	Walmart Inc	30.181.317
69.195	Lockheed Martin Corp	29.886.554
245.268	Zimmer Biomet Holdings Inc	29.543.739
144.012	Caterpillar Inc	28.321.455
627.724	United Airlines Holdings Inc	27.250.943
55.349	Humana Inc	26.441.153
37.574	Regeneron Pharmaceuticals Inc	26.080.581

## US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
432.262	General Electric Co	33.006.429
810.702	Delta Air Lines Inc	26.816.081
160.271	Johnson & Johnson	26.516.036
152.364	Procter & Gamble Co	21.698.175
526.096	United Airlines Holdings Inc	20.669.725
1.058.422	AT&T Inc	18.436.964
173.629	Abbott Laboratories	17.949.018
78.546	Becton Dickinson and Co	17.897.952
121.466	Marriott International Inc Class A	17.804.482
179.211	Medtronic Plc	16.922.895
148.615	Alphabet Inc Class C	16.078.896
263.028	Apollo Global Management Inc	15.444.191
135.407	Applied Materials Inc	14.942.471
454.137	Fifth Third Bancorp	14.912.457
49.792	Parker-Hannifin Corp	14.658.978
312.540	Verizon Communications Inc	14.435.736
321.264	Truist Financial Corp	14.241.296
292.942	Royal Caribbean Cruises Ltd	13.814.216
187.485	Bristol-Myers Squibb Co	13.607.310
245.824	Dow Inc	13.503.746
224.722	Mondelez International Inc Class A	13.493.919
149.961	Raytheon Technologies Corp	13.460.263
18.799	Regeneron Pharmaceuticals Inc	13.256.387
299.878	US Bancorp	13.151.540
347.844	Keurig Dr Pepper Inc	12.790.158
105.428	Valero Energy Corp	11.622.211
296.436	Freeport-McMoRan Inc	11.442.726
93.069	Kimberly-Clark Corp	11.034.670
140.808	General Mills Inc	10.752.768
82.585	Walmart Inc	10.747.725
19.787	UnitedHealth Group Inc	10.547.130
277.089	Boston Scientific Corp	10.532.626
104.628	PayPal Holdings Inc	10.184.009
49.750	CME Group Inc Class A	10.096.149
87.502	EOG Resources Inc	10.012.200
132.691	Rio Tinto Plc ADR	9.733.217
195.061	Mosaic Co	9.485.496
211.223	Kroger Co	9.483.898
210.367	Cisco Systems Inc	9.448.986
202.318	Pfizer Inc	8.991.638
271.891	Bank of America Corp	8.958.952
218.450	Citizens Financial Group Inc	8.812.823

## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
579.248	Okta Inc Class A	59.381.632
209.184	Amazon.com Inc	55.431.064
297.376	Meta Platforms Inc Class A	55.202.506
320.032	JPMorgan Chase & Co	46.245.232
122.880	Adobe Inc	42.658.061
439.376	Zendesk Inc	41.500.241
522.768	NextEra Energy Inc	40.309.891
141.328	Microsoft Corp	40.092.065
666.496	Match Group Inc	39.097.022
365.264	NIKE Inc Class B	38.011.486
613.248	TJX Cos Inc	37.724.762
226.224	Apple Inc	35.267.676
215.328	Salesforce Inc	33.620.989
565.808	Alcoa Corp	33.476.555
96.192	Home Depot Inc	29.666.655
976.032	Equitable Holdings Inc	28.017.082
155.536	Avery Dennison Corp	27.327.540
53.712	Costco Wholesale Corp	25.998.801
58.768	Humana Inc	25.944.088
154.240	Five Below Inc	25.324.648
1.426.176	GAP Inc	24.952.832
280.464	Floor & Decor Holdings Inc Class A	24.046.797
813.664	Uber Technologies Inc	23.793.032
160.384	AbbVie Inc	23.220.114
216.880	Airbus SE	22.895.700
500.928	Boston Scientific Corp	21.734.245
150.400	Dollar Tree Inc	21.593.974
1.334.464	Under Armour Inc Class A	21.242.020
116.768	CME Group Inc Class A	21.101.841
142.480	Chevron Corp	21.100.176
130.992	Workday Inc Class A	21.038.719
208.208	Raytheon Technologies Corp	20.406.848
1.170.096	Sweetgreen Inc Class A	20.360.484
486.608	Chewy Inc Class A	20.220.260
108.208	Netflix Inc	20.089.079
81.280	Union Pacific Corp	19.346.742
42.736	ServiceNow Inc	19.204.224
156.800	Carmax Inc	18.816.000
203.776	WEC Energy Group Inc	18.678.617
132.800	Boeing Co	18.182.928
102.944	Asbury Automotive Group Inc	16.757.221
164.864	Walt Disney Co	16.407.489
161.856	Expedia Group Inc	16.056.583
268.928	Apollo Global Management Inc	15.331.508
46.800	Lululemon Athletica Inc	15.047.873

## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
417.280	Keurig Dr Pepper Inc	14.871.633
72.320	Equifax Inc	13.888.440
541.920	Enterprise Products Partners LP	13.568.949
59.760	Alphabet Inc Class A	12.534.272
100.512	Progressive Corp	12.354.174
78.048	Analog Devices Inc	11.566.635
34.000	S&P Global Inc	11.314.694
90.512	Walmart Inc	11.258.570
10.960.000	Meta Platforms Inc, 4.65%, 15/08/2062	10.940.053
14.640.000	Amazon.com Inc, 3.25%, 12/05/2061	10.577.586
142.448	Fidelity National Information Services Inc	10.551.495
41.824	McDonald's Corp	10.311.247
24.992	Ulta Beauty Inc	9.625.656
31.712	SBA Communications Corp Class A	9.617.146
325.360	CenterPoint Energy Inc	9.552.199
14.560.000	Microsoft Corp, 2.68%, 01/06/2060	9.431.998
227.520	Brookfield Asset Management Inc Class A	9.420.037
28.288	Mastercard Inc Class A	9.132.397
138.336	Mondelez International Inc Class A	8.611.827
13.360.000	Oracle Corp, 3.85%, 01/04/2060	8.542.774

## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.959.920	TJX Cos Inc	130.187.106
2.066.944	Apollo Global Management Inc	130.166.368
1.549.216	NextEra Energy Inc	128.639.641
247.312	Amazon.com Inc	117.929.410
429.904	McDonald's Corp	110.394.248
2.920.432	Keurig Dr Pepper Inc	110.220.960
4.648.880	Enterprise Products Partners LP	109.921.314
119.296	Alphabet Inc Class A	106.362.473
787.616	JPMorgan Chase & Co	98.212.269
448.256	Workday Inc Class A	95.598.469
309.968	Microsoft Corp	91.905.434
525.712	Waste Management Inc	82.798.376
403.824	Salesforce Inc	82.771.877
851.760	Ashland Global Holdings Inc	82.188.590
1.004.096	Activision Blizzard Inc	77.607.601
330.432	Equifax Inc	76.392.571
2.433.184	Equitable Holdings Inc	76.130.802
147.792	ServiceNow Inc	75.905.150
464.640	Apple Inc	75.885.539
161.216	UnitedHealth Group Inc	75.731.053
617.040	IHS Markit Ltd	73.316.577
797.136	Medtronic Plc	73.015.300
507.664	Chevron Corp	72.045.708
1.763.312	Brookfield Infrastructure Partners LP	71.579.533
267.392	Meta Platforms Inc Class A	70.518.396
206.848	Home Depot Inc	68.641.753
392.960	Expedia Group Inc	65.827.289
1.011.472	Lamb Weston Holdings Inc	63.822.914
962.176	Citigroup Inc	63.677.452
256.448	Union Pacific Corp	63.226.084
222.784	Air Products & Chemicals Inc	62.031.241
413.504	Walmart Inc	60.033.344
117.168	Adobe Inc	56.256.694
242.240	CME Group Inc Class A	54.912.214
461.072	Splunk Inc	53.509.368
2.983.040	Dun & Bradstreet Holdings Inc	51.518.477
238.608	Visa Inc Class A	51.332.663
1.495.328	Uber Technologies Inc	51.143.811
1.044.000	Anaplan Inc	50.868.280
288.000	Asbury Automotive Group Inc	49.923.809
1.910.160	Paycor HCM Inc	49.370.162
207.744	FedEx Corp	48.238.238
3.223.968	Legalzoom.com Inc	47.098.154
473.696	WEC Energy Group Inc	46.250.957
297.008	TE Connectivity Ltd	44.804.660

## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
1.140.800	Chewy Inc Class A	44.767.806
217.200	Honeywell International Inc	44.699.136
459.568	Okta Inc Class A	43.459.938
110.208	Humana Inc	42.366.376
771.552	Brookfield Asset Management Inc Class A	41.934.110
219.600	CDW Corp	40.453.529
439.376	Zendesk Inc	39.623.858
66.272	Thermo Fisher Scientific Inc	38.098.638
316.096	NIKE Inc Class B	37.502.089
226.432	Procter & Gamble Co	36.080.474
963.456	nVent Electric Plc	34.082.856
213.152	Marriott International Inc Class A	33.986.106
213.408	Spotify Technology SA	33.029.238
489.712	Mondelez International Inc Class A	32.273.817
206.496	WEX Inc	31.659.329
155.216	Avery Dennison Corp	30.505.852
735.728	Enbridge Inc	30.030.031
1.058.672	CenterPoint Energy Inc	29.292.253
56.144	Costco Wholesale Corp	28.250.077
166.208	Johnson & Johnson	27.867.142
74.688	Mastercard Inc Class A	26.901.805
34.896	BlackRock Inc Class A	25.843.873
158.544	Analog Devices Inc	25.819.523
230.480	Fidelity National Information Services Inc	25.220.316
80.736	SBA Communications Corp Class A	24.910.597
315.600	Amphenol Corp Class A	24.768.322
809.520	Duck Creek Technologies Inc	23.252.267



## US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
71.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	6.477.132
52.000	T-Mobile US Inc	6.145.546
41.000	QUALCOMM Inc	5.966.770
34.000	Dollar Tree Inc	4.857.727
37.000	Electronic Arts Inc	4.583.601
29.700	Walt Disney Co	4.545.752
105.000	Simply Good Foods Co	3.689.532
1.200	Amazon.com Inc	3.675.658
50.000	TJX Cos Inc	3.524.869
55.000	Newmont Corp	3.483.957
17.200	Stanley Black & Decker Inc	3.107.198
30.500	Brunswick Corp	2.759.294
70.000	Brookfield Renewable Corp Class A	2.710.021
18.300	Eagle Materials Inc	2.709.639
38.000	Apollo Global Management Inc	2.568.297
120.000	Graphic Packaging Holding Co	2.386.417
9.500	Motorola Solutions Inc	2.116.514
8.700	HCA Healthcare Inc	2.034.068
6.300	Berkshire Hathaway Inc Class B	1.960.127
20.300	Columbia Sportswear Co	1.910.454
12.500	NIKE Inc Class B	1.823.893
5.900	Microsoft Corp	1.770.316
7.100	McDonald's Corp	1.756.632
13.500	Intercontinental Exchange Inc	1.720.008
1.100	Cable One Inc	1.719.641
600	Alphabet Inc Class C	1.578.670
16.000	Ball Corp	1.475.945
42.100	CSX Corp	1.437.969
26.200	Brookfield Asset Management Inc Class A	1.404.905
39.000	Aramark	1.337.691
22.000	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	1.299.746
6.500	Chubb Ltd	1.274.875
13.200	Raytheon Technologies Corp	1.202.216
3.000	Deere & Co	1.135.201
7.100	JPMorgan Chase & Co	1.052.403

## US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
370.800	Comcast Corp Class A	15.850.838
104.400	Apple Inc	15.166.523
325.400	Cisco Systems Inc	15.037.379
51.300	Microsoft Corp	13.026.434
44.000	Berkshire Hathaway Inc Class B	12.694.830
132.200	Stanley Black & Decker Inc	12.377.837
48.700	Motorola Solutions Inc	11.799.990
45.100	HCA Healthcare Inc	9.443.553
41.700	Chubb Ltd	8.334.571
58.800	Alphabet Inc Class C	8.242.292
39.700	Lowe's Cos Inc	7.687.684
81.800	Raytheon Technologies Corp	7.615.687
132.200	Ball Corp	7.608.728
104.000	Lamb Weston Holdings Inc	7.561.029
6.400	Cable One Inc	7.355.860
26.300	McDonald's Corp	6.687.636
135.600	Pfizer Inc	6.675.850
59.600	Amazon.com Inc	6.582.425
79.100	Charles Schwab Corp	5.896.076
198.500	CSX Corp	5.880.773
170.200	Aramark	5.828.243
74.500	PayPal Holdings Inc	5.798.113
134.500	Brookfield Asset Management Inc Class A	5.792.967
46.800	JPMorgan Chase & Co	5.654.537
68.800	Activision Blizzard Inc	5.428.839
53.100	Walt Disney Co	5.377.179
72.500	Brunswick Corp	5.078.967
92.200	Apollo Global Management Inc	4.878.253
159.800	US Foods Holding Corp	4.820.414
221.400	Graphic Packaging Holding Co	4.702.827
61.800	TJX Cos Inc	4.228.602
27.800	T-Mobile US Inc	4.021.388
40.000	Intercontinental Exchange Inc	3.947.671
2.100	Booking Holdings Inc	3.890.442
53.500	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	3.731.242
14.500	Rockwell Automation Inc	3.380.229
31.800	NIKE Inc Class B	3.227.283
50.900	Mondelez International Inc Class A	3.093.746

## US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
649.246	Ventas Inc	37.311.666
538.966	Realty Income Corp	35.852.166
441.935	Iron Mountain Inc	21.539.662
119.784	Crown Castle Inc	19.577.697
68.977	American Tower Corp	17.506.473
125.021	Digital Realty Trust Inc	16.946.395
350.133	UDR Inc	15.783.744
579.869	Healthpeak Properties Inc	15.022.794
111.585	Prologis Inc	14.907.571
167.310	Welltower Inc	13.522.223
222.115	Duke Realty Corp	12.587.031
115.506	Simon Property Group Inc	12.255.195
71.787	EastGroup Properties Inc	11.805.932
31.415	Public Storage	10.578.170
207.912	Apartment Income REIT Corp	9.161.959
572.484	Medical Properties Trust Inc	8.783.864
102.710	Ryman Hospitality Properties Inc	8.347.969
27.739	Essex Property Trust Inc	8.299.991
59.513	Alexandria Real Estate Equities Inc	8.108.879
63.247	Life Storage Inc	6.912.560
309.369	Kimco Realty Corp	6.851.137
71.081	Equity Residential	6.035.020
35.944	Sun Communities Inc	5.972.025
7.828	Equinix Inc	5.586.144
35.812	Marriott International Inc Class A	5.182.951
52.592	Boston Properties Inc	5.097.431
103.831	American Homes 4 Rent Class A	3.835.035

## US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
408.511	Prologis Inc	52.784.687
253.893	Simon Property Group Inc	29.142.444
117.843	American Tower Corp	28.979.841
37.542	Equinix Inc	25.944.119
155.742	Crown Castle Inc	25.300.993
278.467	Equity Residential	20.654.088
220.604	Welltower Inc	18.419.272
513.291	VICI Properties Inc	15.989.147
309.435	Brookfield Asset Management Inc Class A	14.266.612
375.390	Weyerhaeuser Co	13.701.194
544.736	Healthpeak Properties Inc	13.529.957
39.511	Public Storage	12.971.574
89.899	Camden Property Trust	11.814.152
255.214	Ventas Inc	11.691.337
192.933	Duke Realty Corp	11.235.015
40.654	Essex Property Trust Inc	11.007.770
341.648	Douglas Emmett Inc	10.879.064
362.855	Healthcare Trust of America Inc Class A	10.257.138
382.419	Four Corners Property Trust Inc	10.167.515
114.190	Boston Properties Inc	9.369.233
102.710	Ryman Hospitality Properties Inc	9.190.663
59.513	Alexandria Real Estate Equities Inc	8.629.341
126.056	Equity LifeStyle Properties Inc	8.617.413
1.408.806	DigitalBridge Group Inc	7.416.422
115.314	Realty Income Corp	7.207.469
52.759	Digital Realty Trust Inc	6.536.377
120.718	Kilroy Realty Corp	6.300.909
34.177	Extra Space Storage Inc	6.282.286
19.005	SBA Communications Corp Class A	5.964.577
34.823	Sun Communities Inc	5.601.384
35.812	Marriott International Inc Class A	5.472.923
239.220	Kimco Realty Corp	5.253.849
115.886	Apartment Income REIT Corp	5.032.510
134.263	Invitation Homes Inc	4.971.133

## US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
155.642	Kirby Corp	10.414.058
788.856	Southwestern Energy Co	5.796.842
104.194	Matador Resources Co	5.745.738
147.572	United Community Banks Inc	5.277.735
3.072	Texas Pacific Land Corp	5.034.300
129.525	FormFactor Inc	4.593.178
118.786	IAA Inc	4.555.244
50.179	Advanced Energy Industries Inc	4.333.436
15.723	Valmont Industries Inc	4.297.829
12.010	Pool Corp	4.261.969
66.692	Lattice Semiconductor Corp	3.817.988
28.523	FirstService Corp	3.647.216
59.177	Stock Yards Bancorp Inc	3.645.825
20.479	Nexstar Media Group Inc Class A	3.601.779
17.024	Bio-Techne Corp	3.585.506
36.689	Fox Factory Holding Corp	3.562.844
33.725	MKS Instruments Inc	3.557.896
68.958	Glacier Bancorp Inc	3.538.865
14.295	Littelfuse Inc	3.449.825
21.305	FTI Consulting Inc	3.425.544
26.800	Manhattan Associates Inc	3.423.704
6.516	Chemed Corp	3.207.162
23.942	Qualys Inc	3.105.284
39.442	Power Integrations Inc	3.015.218
41.886	Haemonetics Corp	2.984.051
16.424	Asbury Automotive Group Inc	2.917.532
22.732	SPS Commerce Inc	2.844.652
13.124	RBC Bearings Inc	2.818.759
49.139	CommVault Systems Inc	2.789.841
20.428	Cullen/Frost Bankers Inc	2.751.240
22.637	CSW Industrials Inc	2.689.636
27.240	Exponent Inc	2.645.684
34.175	Prosperity Bancshares Inc	2.484.816
2.896	Cable One Inc	2.482.954
25.472	Toro Co	2.447.955
19.092	Eagle Materials Inc	2.440.523

## US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
85.752	CMC Materials Inc	15.599.038
259.181	IAA Inc	9.785.792
65.442	MSA Safety Inc	8.221.188
18.717	Pool Corp	7.511.844
40.193	Nexstar Media Group Inc Class A	7.087.448
50.557	Novanta Inc	6.757.820
106.884	AAON Inc	6.227.276
47.219	Manhattan Associates Inc	6.161.752
18.043	West Pharmaceutical Services Inc	6.059.439
15.670	Bio-Techne Corp	5.483.225
22.760	Lithia Motors Inc Class A	5.328.994
11.131	Fair Isaac Corp	5.183.680
99.949	Cognex Corp	5.112.451
24.529	RBC Bearings Inc	4.959.078
36.217	Lancaster Colony Corp	4.936.574
36.689	Qualys Inc	4.835.236
17.368	Rogers Corp	4.735.261
48.324	Exponent Inc	4.577.079
56.940	Power Integrations Inc	4.554.700
9.409	Chemed Corp	4.466.983
76.479	Lattice Semiconductor Corp	4.235.932
32.815	SPS Commerce Inc	4.024.903
32.803	RLI Corp	3.694.869
15.215	Littelfuse Inc	3.662.557
83.561	Computer Services Inc	3.639.212
143.420	First Hawaiian Inc	3.596.117
113.475	Columbia Banking System Inc	3.493.565
24.914	Cullen/Frost Bankers Inc	3.385.772
81.525	First Financial Bankshares Inc	3.378.063
13.518	Valmont Industries Inc	3.349.078
23.208	Tetra Tech Inc	3.345.928
93.731	Rollins Inc	3.345.149
36.774	Toro Co	3.314.773
18.882	Asbury Automotive Group Inc	3.285.845
40.084	Bank of Hawaii Corp	3.238.562
19.808	FTI Consulting Inc	3.223.059
32.950	Fox Factory Holding Corp	3.217.123
62.094	Glacier Bancorp Inc	3.199.885

## US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US\$
62.026	KBR Inc	3.019.325
24.023	Crown Holdings Inc	2.688.540
43.546	Devon Energy Corp	2.664.454
89.752	Rambus Inc	2.527.635
45.878	Ciena Corp	2.426.655
59.953	Viasat Inc	2.224.030
81.761	Criteo SA ADR	2.218.876
160.287	Unisys Corp	2.176.297
87.586	Cleveland-Cliffs Inc	2.166.040
705.986	Ribbon Communications Inc	2.159.190
140.525	Kyndryl Holdings Inc	1.931.002
80.725	Veeco Instruments Inc	1.928.070
81.907	International Game Technology Plc	1.879.962
80.272	Resideo Technologies Inc	1.840.719
10.678	Avery Dennison Corp	1.825.914
160.763	Lions Gate Entertainment Corp Class B	1.822.977
30.410	New Relic Inc	1.741.739
30.486	MACOM Technology Solutions Holdings Inc Class H	1.731.194
24.204	Acadia Healthcare Co Inc	1.665.710
20.400	Ormat Technologies Inc	1.621.540
78.513	Stratasys Ltd	1.501.008
4.693	Molina Healthcare Inc	1.485.063
16.607	Comerica Inc	1.420.044
33.484	BankUnited Inc	1.354.945
26.445	Stericycle Inc	1.347.718
177.203	Cognyte Software Ltd	1.322.532
78.728	Xperi Holding Corp	1.288.121
74.109	KAR Auction Services Inc	1.254.768
24.818	AerCap Holdings NV	1.251.318
88.490	Huntington Bancshares Inc	1.251.175
243.669	Conduent Inc	1.174.831
24.845	Verint Systems Inc	1.170.915
50.368	Vistra Corp	1.161.751
19.193	Texas Capital Bancshares Inc	1.119.783
26.336	ODP Corp	1.084.225
4.158	Charles River Laboratories International Inc	1.071.320
33.044	Cerence Inc	1.054.543
140.865	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	1.054.288
16.450	Wix.com Ltd	1.051.669
17.360	Arcosa Inc	1.017.697
25.870	TreeHouse Foods Inc	1.000.296
39.620	Radware Ltd	999.726

## US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US\$
141.814	Mandiant Inc	3.157.364
42.081	Devon Energy Corp	3.003.705
84.563	Ping Identity Holding Corp	2.386.943
30.359	ODP Corp	1.217.365
8.471	Crown Holdings Inc	1.017.170
6.947	Entegris Inc	935.213
36.108	Emergent BioSolutions Inc	695.300
33.044	Cerence Inc	587.350
48.221	Adeia Inc	510.949
18.312	Box Inc Class A	510.806
5.534	Impinj Inc	426.164
34.802	eHealth Inc	105.664
6.602	Loyalty Ventures Inc	20.864



# ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die wesentlichen vom Fonds angewandten Bilanzierungsgrundsätze sind im Folgenden beschrieben:

#### Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

Der Jahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen und irischem Recht in Gestalt des Companies Act 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011“) (in ihrer geltenden Fassung) und dem Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) erstellt. Der Jahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ erstellt. Die in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätze für die Erstellung von Abschlüssen, die ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermitteln, sind diejenigen, die von Chartered Accountants Irland veröffentlicht und vom Financial Reporting Council („FRC“) herausgegeben worden sind.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, berichtigt um die erfolgswirksame Neubewertung finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert. Bewertungszeitpunkt ist Marktschluss am jeweiligen Handelstag. Der Handelstag ist jeder Geschäftstag oder sonstige Tag, den die Direktoren festlegen und der Verwaltungsstelle und den Anteilhabern im Voraus mitteilen. Das Direktorium hat die Fähigkeit des Fonds zur weiteren Unternehmensfortführung bewertet und hat sich vergewissert, dass der Fonds über die Ressourcen verfügt, um seine Geschäfte auf absehbare Zeit und für mindestens zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Abschlusses fortzuführen. Ferner sind den Direktoren keine wesentlichen Unsicherheiten bekannt, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung wecken könnten. Der Abschluss wird daher auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt.

Das Format und bestimmte Passagen des Wortlauts des Jahresabschlusses weichen in bestimmten Punkten von den im Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) und FRS 102 enthaltenen ab, so dass sie nach Auffassung der Direktoren den Charakter des Geschäfts des Fonds als Investmentfonds besser widerspiegeln. Der Fonds erfüllt die entsprechenden Kriterien, um von der für bestimmte offene Investmentgesellschaften nach FRS 102 möglichen Befreiung von der Erstellung einer Kapitalflussrechnung Gebrauch zu machen.

Die Aufstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit FRS 102 erfordert die Verwendung bestimmter kritischer Schätzungen bei der Rechnungslegung. Außerdem müssen die Direktoren bei der Anwendung der Bilanzierungsgrundsätze des Fonds ihr Ermessen ausüben. Die Bereiche, die ein höheres Maß an Ermessensspielraum oder Komplexität erfordern, oder solche Bereiche, in denen Annahmen und Schätzungen für den Abschluss bedeutungsvoll sind, wie die Besteuerung oder die Annahme der Unternehmensfortführung, werden in den folgenden Anmerkungen offengelegt. Angaben zu Unsicherheiten bei Annahmen und Schätzungen mit einem erheblichen Risiko daraus resultierender wesentlicher Berichtigungen der Buchwerte von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 sind in Anmerkung 12 enthalten und beziehen sich auf die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts anhand maßgeblicher nicht beobachtbarer Parameter.

#### Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

##### (i) Klassifizierung

Der Fonds wendet die Bestimmungen zu Ausweis und Bewertung des Internationalen Rechnungslegungsstandards 9: „Financial Instruments“ („IFRS 9“) sowie die die Offenlegungs- und Darstellungspflichten des FRS 102 auf alle Finanzinstrumente an. Gemäß IFRS 9 klassifiziert der Fonds finanzielle Vermögenswerte beim erstmaligen Ansatz als zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten oder erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Ein finanzieller Vermögenswert wird zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet, wenn er beide der folgenden Bedingungen erfüllt und nicht als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft ist: (a) er wird im Rahmen eines Geschäftsmodells gehalten, dessen Ziel das Halten von Vermögenswerten zur Inanspruchnahme von Einnahmen ist; und (b) seine Vertragsbedingungen führen zu festgelegten Zeitpunkten zu Einnahmen, die ausschließlich Tilgung und Zinszahlungen sind (Solely payments of principal and interest, „SPPI“). Alle anderen finanziellen Vermögenswerte der Portfolios werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Der Fonds hat seine Anlagen als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte bzw. finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Sämtliche Derivate, die Nettoforderungen darstellen (positiver beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten ausgewiesen. Sämtliche Derivate, die Nettoverbindlichkeiten darstellen (negativer beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Finanzielle Vermögenswerte, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte Beträge von Brokern und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

Finanzielle Verbindlichkeiten, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte an Broker zahlbare Beträge und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

##### (ii) Erstbewertung

Käufe und Verkäufe von Finanzinstrumenten werden in den Abschlüssen zum Handelsdatum verbucht. Realisierte Gewinne und Verluste aus Veräußerungen von Finanzinstrumenten werden anhand der „First in/First out“-Methode berechnet. Die Erstbewertung von Finanzinstrumenten, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte kategorisiert sind, erfolgt zum beizulegenden Zeitwert, und die Transaktionskosten für solche Wertpapiere werden direkt in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)****(iii) Folgebewertung**

Nach der Erstbewertung bewertet der Fonds Finanzinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, zu ihren beizulegenden Zeitwerten. Der Zeitwert ist der Betrag, für den ein Vermögenswert in einer Transaktion zu Marktbedingungen zwischen sachverständigen, vertragswilligen Parteien getauscht oder eine Verbindlichkeit beglichen werden könnte. Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten basiert auf deren an einer anerkannten Börse notierten offiziellen Marktpreisen oder wird im Fall nicht börsennotierter Instrumente von einem angesehenen Broker/einer angesehenen Gegenpartei bezogen, jeweils zum Bilanzstichtag und ohne Abzug für geschätzte zukünftige Verkaufskosten. Gemäß IFRS 9 werden die Wertpapiere und sonstigen Vermögenswerte der Gesellschaft zum letzten Marktkurs per 31. Dezember 2022 und 2021 bewertet, um das den Inhabern rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen („Nettovermögen“) zu bestimmen.

Die Direktoren können jedoch den Wert von finanziellen Vermögenswerten anpassen, wenn sie dies für erforderlich erachten, um deren marktgerechten Wert besser widerzuspiegeln. Ist kein an einer anerkannten Börse notierter offizieller Marktpreis und kein Preis von einem Broker/einer Gegenpartei verfügbar, so wird der wahrscheinliche Realisationswert mit Sorgfalt und in gutem Glauben gemäß der Bewertungspolitik des Fonds berechnet. Dieser wahrscheinliche Realisationswert kann von der Verwaltungsstelle anhand von Bewertungsmethoden ermittelt werden, u. a. unter Zugrundelegung marktüblicher Transaktionen, Bezugnahme auf den aktuellen beizulegenden Zeitwert eines anderen Instruments, das im Wesentlichen gleich ist, Anwendung von Discounted-Cashflow-Analysen, Preisbildungsmodellen für Optionsscheine und jeder anderen Bewertungsmethode, die eine verlässliche Preisschätzung unter Annahme der gegenwärtigen Markttransaktionen ergibt. Weitere Einzelheiten zu den Bewertungsgrundsätzen für alle Wertpapierarten finden Sie im Abschnitt „Beizulegender Zeitwert von Anlagen“ in Anmerkung 12. Anschließende Änderungen im Zeitwert der Kategorie erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende Finanzinstrumente werden in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

**(iv) Ausbuchung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten**

Der Fonds bucht einen finanziellen Vermögenswert aus, wenn die vertraglichen Ansprüche auf Einnahmen aus dem Vermögenswert erloschen sind oder wenn die Vermögenswerte übertragen werden und diese Übertragung eine Ausbuchung gemäß IFRS 9 begründet. Der Fonds bucht eine finanzielle Verbindlichkeit aus, wenn er von den entsprechenden vertraglichen Verpflichtungen befreit ist bzw. wenn diese erloschen oder abgelaufen sind.

**Immobilienaktiengesellschaften**

Anteile an Immobilienaktiengesellschaften werden zum Geldkurs oder, wenn ein solcher nicht verfügbar ist, zum letzten verfügbaren Nettoinventarwert („NIW“) bewertet. Anteile, die an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, werden zum letzten notierten Handelskurs oder Mittelkurs bewertet oder, sofern diese nicht erhältlich oder repräsentativ sind, zum letzten verfügbaren, für den Organismus für gemeinsame Anlagen relevant erscheinenden NIW.

**Investmentfonds**

Der beizulegende Zeitwert einer Anlage, bei der es sich um einen Anteil oder eine Beteiligung an einem Investmentfonds handelt, ist der letzte verfügbare, ungeprüfte NIW dieses Anteils bzw. dieser Beteiligung.

**Mittelfristige Schuldverschreibungen**

Bestimmte Portfolios können in direkte Schuldtitel investieren, bei denen es sich um Anteile an Beträgen handelt, die von Unternehmen, staatlichen Stellen oder anderen Kreditnehmern an Kreditgeber oder Kreditsyndikate geschuldet werden. Die Anlagen eines Portfolios in Kredite können in Form von Beteiligungen an Krediten oder Abtretungen aller oder eines Teils der Kredite von Dritten („Bankkredite“) erfolgen. Ein Bankkredit wird häufig von einer Bank oder einem anderen Finanzinstitut (dem „Kreditgeber“) verwaltet, das als Agent für alle Inhaber fungiert. Der Agent verwaltet die Bedingungen des Kredits, wie im Kreditvertrag festgelegt. Bei der Anlage in eine Kreditbeteiligung hat ein Portfolio das Recht, Kapitalzahlungen, Zinsen und etwaige Gebühren, auf die es Anspruch hat, lediglich von dem Kreditgeber zu erhalten, der den Kreditvertrag verkauft, und nur bei Eingang von Zahlungen des Kreditnehmers beim Kreditgeber. Allgemein hat ein Portfolio kein Recht, die Einhaltung der Bedingungen des Kreditvertrags mit dem Kreditnehmer durchzusetzen. Infolgedessen kann ein Portfolio dem Kreditrisiko durch sowohl den Kreditnehmer als auch durch den Kreditgeber, der den Kreditvertrag verkauft, ausgesetzt sein. Wenn ein Portfolio Abtretungen von Kreditgebern erwirbt, erwirbt es direkte Rechte gegenüber dem Kreditnehmer des Kredits.

Das Portfolio kann beim Handel mit Abtretungen und Beteiligungen an Dritte Schwierigkeiten haben. Es kann Beschränkungen für Übertragungen geben und es können nur begrenzte Möglichkeiten bestehen, solche Wertpapiere auf Sekundärmärkten zu verkaufen. Infolgedessen ist das Portfolio möglicherweise nicht in der Lage, Abtretungen oder Beteiligungen zum gewünschten Zeitpunkt zu verkaufen oder muss zu einem Preis unter dem beizulegenden Zeitwert verkaufen.

Das Portfolio kann einen Kreditvertrag über einen bestimmten zugesagten Betrag abschließen, doch wird dieser unter Umständen nicht in voller Höhe vom Kreditnehmer in Anspruch genommen. Diese nicht finanzierten Zusagen stellen die verbleibende Verpflichtung des Portfolios gegenüber dem Kreditnehmer dar. Der Kreditnehmer kann zu jedem Zeitpunkt bis zum Fälligkeitsdatum der Emission den nicht finanzierten Teil einfordern. Der beizulegende Zeitwert dieser ungedeckten Kreditzusagen ist in der Bilanz unter „Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen“ enthalten.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

#### Participatory Notes

Die Portfolios können in Participatory Notes investieren. Participatory Notes, die voll eingezahlt sind und einen Ausübungskurs von null haben, weisen die gleichen Risiko/Rendite-Charakteristika auf, die im Falle eines direkten Kaufs der zugrunde liegenden Aktien vorliegen würden.

#### Forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities

Zu den Parametern, die dazu verwendet werden, forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities zu bewerten, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe an Faktoren berücksichtigen. Hierzu können folgende Punkte gehören: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen wie zum Beispiel Benchmarkrenditen, gemeldete Trades, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, Benchmarkwertpapiere, Gebote, Angebote und Referenzdaten wie zum Beispiel falls verfügbar Veröffentlichungen im Bereich der Marktforschung.

#### TBA-Wertpapiere

Die Portfolios dürfen TBA-Kaufverpflichtungen eingehen, um Wertpapiere zu einem festen Preis und zu einem über den Abrechnungszeitpunkt hinausgehenden Termin zu kaufen. Obwohl der Stückpreis festgelegt worden ist, wurde der Nominalwert noch nicht bestimmt. Bis zum Abrechnungstermin hält und verwaltet das Portfolio in Höhe des Kaufpreises der TBA-Kaufverpflichtung ausreichende Geldmittel oder erstklassige Schuldtitel. Das Portfolio kann auch andere in seinem Besitz befindlichen Wertpapiere für eine Vereinbarung zur Glattstellung der Position verwenden. Erträge aus den Wertpapieren werden erst zum Abrechnungstermin realisiert. Offene TBA-Kaufverpflichtungen wurden mit dem aktuellen Marktwert bewertet.

Die Portfolios dürfen TBA-Verkaufverpflichtungen eingehen, um ihre Portfoliositionen abzusichern oder um hypothekenbesicherte Wertpapiere zu verkaufen, die verzögerten Erfüllungsvereinbarungen (Delayed Delivery) unterliegen. Erlöse aus den TBA-Verkaufverpflichtungen gelten erst zum vertraglichen Abrechnungstermin als realisiert. Solange eine TBA-Verkaufverpflichtung nicht abgerechnet ist, hat das Portfolio ein gleichwertig erfüllbares Wertpapier oder eine glattstellende TBA-Abnahmeverpflichtung, die am oder vor dem Verkaufsverpflichtungstermin zu erfüllen ist, zur „Deckung“ der Verkaufsverpflichtung zu halten. Offene TBA-Kaufverpflichtungen werden gemäß dem in den Bilanzierungsgrundsätzen beschriebenen Verfahren zum aktuellen Marktwert bewertet.

#### Bedingte Pflichtwandelanleihen

Bedingte Pflichtwandelanleihen (Contingent Convertible Securities, kurz „CoCos“) sind eine Gattung hybrider Wertpapiere, deren Nennwert bei Eintritt bestimmter Auslöser entweder in Eigenkapital umgewandelt oder abgeschrieben wird. Die Auslöser stehen generell in Zusammenhang mit aufsichtsbehördlich vorgegebenen Kapitalquoten oder aufsichtsbehördlichen Maßnahmen, die die weitere Fähigkeit des Emittenten zur Unternehmensfortführung infrage stellen. Die einzigartigen Merkmale von CoCos zur Umwandlung in Eigenkapital oder die Abschreibung sind auf den Emittenten und dessen aufsichtsbehördliche Auflagen zugeschnitten. In aller Regel werden CoCos als nachrangige Schuldtitel begeben, um vor einer Umwandlung die entsprechende Eigenkapitalunterlegung sicherzustellen. Ferner haben CoCos nicht unbedingt eine festgesetzte Laufzeit und können absolut ermessensfreie Kupons aufweisen, die nach Ermessen des Emittenten gestrichen oder von der zuständigen Aufsichtsbehörde untersagt werden können, um dem Emittenten zu ermöglichen, Verluste zu absorbieren.

#### Devisenterminkontrakte

Ein Devisenterminkontrakt ist eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien, eine Währung an einem zukünftigen Datum zu einem festgelegten Preis zu kaufen und zu verkaufen. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Devisenterminkursen. Devisenterminkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, und die Wertveränderung wird vom Portfolio als nicht realisierter Gewinn oder Verlust ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste in Höhe der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seines Abschlusses und dem Wert zum Glattstellungszeitpunkt werden nach Lieferung bzw. Entgegennahme der Währung oder, wenn ein Devisenterminkontrakt durch Eingehen eines neuen Devisenterminkontrakts mit demselben Makler glattgestellt wird, nach Abrechnung des Nettogewinns bzw. -verlusts verbucht.

#### Futures-Kontrakte

Futures-Kontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Anfängliche Einschüsse werden beim Eingehen der Futures-Kontrakte getätigt und erfolgen im Allgemeinen in Barmitteln oder Barmitteläquivalenten. Der beizulegende Zeitwert von Futures-Kontrakten basiert auf ihren täglich notierten Abrechnungspreisen. Veränderungen im Wert offener Futures-Kontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten bis zur Glattstellung der Kontrakte ausgewiesen, danach erfolgt der Ausweis realisierter Gewinne und Verluste. Gewinne bzw. Verluste aus offenen Futures-Kontrakten werden in der Aufstellung des Wertpapierbestands des jeweiligen Portfolios aufgeführt und in der Bilanz jeweils unter den erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten bzw. Verbindlichkeiten ausgewiesen.

#### Swap-Kontrakte

Ein Swap-Kontrakt ist eine außerbörsliche Vereinbarung zwischen einem Portfolio und einer Gegenpartei, die Rendite eines Instruments gegen die Rendite eines anderen Instruments zu tauschen. Manche Swap-Kontrakte werden netto abgewickelt. Beim Eingehen eines Swap-Kontrakts im Freiverkehr („OTC-Kontrakt“) und während der Laufzeit der Transaktion kann das Portfolio und/oder der Swap-Kontrahent gemäß den Bestimmungen der jeweiligen Swap-Vereinbarungen Bargeld oder Wertpapiere als Sicherheiten stellen bzw. entgegennehmen, damit für den Fall eines Zahlungsausfalls oder eines Konkurses/einer Insolvenz werthaltige Vermögenswerte und Rückgriffsmöglichkeiten bereitstehen. Einige Clearingstellen bieten die Abwicklung von eingeschränkten Arten von Swaps. Bei einer abgewickelten Swap-Transaktion geht ein Portfolio die Transaktion in der Regel mit einem Finanzinstitut als Gegenpartei ein, die dann durch eine zentrale Clearingstelle abgewickelt wird. Nach Annahme eines Swaps durch eine zentrale Clearingstelle erlischt der Swap und wird durch einen Swap mit der Clearingstelle ersetzt, dadurch wird das Kreditrisiko des Portfolios gegenüber der ursprünglichen Gegenpartei reduziert oder eliminiert.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Swap-Kontrakte (Fortsetzung)**

Ein Portfolio muss in der Regel eine bestimmte Höhe einer Einschuss- und Nachschussmarge bei der Clearingstelle oder nach Weisung der Clearingstelle hinterlegen. Die tägliche Veränderung in der Bewertung wird als Forderung oder Verbindlichkeit für Nachschusszahlungen verbucht und in bar mit der zentralen Clearing-Partei abgewickelt.

*Zins-/Inflation-Swaps*

Ein Portfolio kann Zins- oder Inflation-Swaps eingehen. Dabei handelt es sich um Vereinbarungen zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis eines fiktiven Kapitalbetrags, mit denen das Zinsrisiko eines Portfolios gesteuert wird. Sowohl bei Zinsswaps als auch bei Inflation-Swaps verpflichtet sich eine Partei, der Swap-Gegenpartei eine festverzinsliche Zahlung zu leisten, während die andere Partei dem Portfolio eine variabel verzinsliche Zahlung leistet. Zinsswap- und Inflation-Swapkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, in manchen Fällen auf Basis von Notierungen von Kontrahenten und in anderen Fällen auf Basis von Notierungen von Kursanbietern. Die Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Geleistete und vereinnahmte Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Einige Zinsswaps können als Forward Starting Swaps betrachtet werden. Abgrenzungen auf Forward Starting Swaps beginnen zu einem zukünftigen Zeitpunkt.

*Credit Default Swaps*

Ein Credit Default Swap ist ein bilateraler Finanzkontrakt, bei dem der Absicherungskäufer eine Gebühr zahlt (in der Regel ausgedrückt in Basispunkten p. a. auf den Nennbetrag) und vom Absicherungsverkäufer im Gegenzug dafür eine Zahlung erhält, wenn in Bezug auf einen Referenzemittenten ein bestimmtes Kreditereignis eintritt, wie z. B. ein Konkurs, ein Zahlungsausfall oder eine Restrukturierung. Die Kreditereignisse und Abwicklungsmechanismen, die angewandt werden, um die Ausfallzahlung zu bestimmen, werden zwischen den Kontrahenten zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses ausgehandelt.

Sobald der Eintritt des Kreditereignisses erklärt wird, ist der Absicherungskäufer berechtigt, den Kontrakt abzuwickeln. Die Abwicklung erfolgt in der Regel physisch, wobei der Absicherungskäufer das Recht hat, Anleihen des Referenzemittenten bis zur Höhe des Nominalwertes des Kontrakts zu liefern. Im Gegenzug erhält der Absicherungskäufer den Nennwert dieser Schuldtitel. Absicherungsverkäufe sind das synthetische Äquivalent eines Kaufs einer Anleihe oder anderen Art von Schuldtitel. Absicherungskäufe sind das Äquivalent eines synthetischen Leerverkaufs oder der Absicherung einer Anleihe oder eines anderen Kreditengagements. Bei Credit Default Swaps auf Kreditindizes leistet eine Partei einen Zahlungsstrom zugunsten einer anderen Partei und erwirbt dafür einen Anspruch auf einen bestimmten Ertrag im Falle einer Abschreibung, einer Minderung des Grundkapitals, einer Minderung der Zinsen oder des Zahlungsausfalls aller oder eines Teils der Referenzemittenten, aus denen der Kreditindex besteht. Ein Kreditindex ist eine Auswahl aus einem Korb von Kreditinstrumenten oder Engagements, die als repräsentativ für einen Teil des gesamten Kreditmarktes angesehen wird. Der Index kann unter anderem aus folgenden Komponenten bestehen: Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating, hochverzinsliche Wertpapiere, ABS-Anleihen, Schwellenmarktpapiere und/oder verschiedenen Bonitätsratings innerhalb jedes Sektors. Kreditindizes werden gehandelt, indem Credit Default Swaps mit standardisierten Bedingungen, wie z. B. einem festen Spread und standardisierten Fälligkeitsdaten eingesetzt werden. Ein Credit Default Swap auf einen Index bezieht sich auf alle Indexkomponenten, und bei Eintritt eines Zahlungsausfalls wird das Kreditereignis basierend auf der Gewichtung der Indexkomponente beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, in der Regel alle sechs Monate, und in den meisten Indizes sind alle Komponenten gleich gewichtet.

Der Einsatz von Credit Default Swaps ist insoweit beschränkt, dass der Nutzen für das Portfolio dem Nutzen entsprechen muss, der durch ein direktes Investment in den Basisinstrumenten erzielt werden könnte, und dass die Swaps ein Portfolio keinen Risiken aussetzen dürfen, die es ansonsten nicht eingehen würde (außer dem Risiko in Bezug auf den Kontrahenten des Credit Default Swap). Die bei Abschluss bei einem Portfolio als Absicherungsverkäufer eingehende Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Verbindlichkeit ausgewiesen. Eine bei Abschluss von einem Portfolio als Absicherungskäufer geleistete Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Vermögenswert ausgewiesen. Bei einem Portfolio eingehende oder von diesem geleistete Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Credit Default Swaps werden mit Hilfe eines Pricing-Service-Anbieters bewertet. Ist kein Pricing-Service-Anbieter verfügbar, können Kontrakte täglich zum Marktpreis bewertet werden. Dabei beruht die Bewertung auf Kursnotierungen von Kontrahenten oder auf Berechnungen unter Verwendung von Bewertungsmodellen. Eine etwaige Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn oder Verlust verbucht. Zahlungen, die infolge eines Kreditereignisses oder der Beendigung des Vertrages eingehen bzw. geleistet werden, werden nach Abzug eines anteiligen Betrags der Vorauszahlung als realisierte Gewinne oder Verluste verbucht.

*Total Return Swaps*

Total Return Swaps beinhalten die Verpflichtung zur Zahlung eines festen oder variablen Zinssatzes im Gegenzug für eine marktabhängige Rendite auf Basis eines Nominalwerts. Das Portfolio erhält eine Zahlung oder leistet eine Zahlung an die Gegenpartei in dem Maße, in dem die Gesamrendite des Referenztitels oder -index, der dem Total Return Swap zugrunde liegt, die gegenläufige Zinsverpflichtung über- oder unterschreitet. Der Abschluss von Total Return Swaps kann mit bestimmten Risiken verbunden sein, darunter der Ausfall der Gegenpartei, Illiquidität oder ungünstige Veränderungen des Werts des zugrunde liegenden Referenztitels oder -index. Der Barausgleich in und aus den Swaps kann nach dem Ermessen des Portfoliomanagements und der Gegenpartei während der Laufzeit der Vereinbarung zu einem Reset- oder einem anderen Datum erfolgen und wird im Allgemeinen auf der Grundlage von Grenz- und Schwellenwerten bestimmt, die im Rahmen einer zwischen dem Portfoliomanagement und der Gegenpartei getroffenen Vereinbarung festgelegt werden. Bei Basket-Swaps können die Cashflows, je nach Lokalwährung der Positionen innerhalb der Swaps, auf verschiedene Fremdwährungen lauten.

Etwaige Bewertungsveränderungen werden als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Geleistete und vereinnahmte Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Der Fonds legt ausstehende Total Return Swaps am Jahresende im Anlageportfolio offen. Für die am 31. Dezember 2022 und am 31. Dezember 2021 beendeten Geschäftsjahre ist der beizulegende Zeitwert der Total Return Swaps in der Aufstellung des Wertpapierbestands und in der Bilanz als nicht realisierter Nettogewinn oder -verlust ausgewiesen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

#### Swap-Kontrakte (Fortsetzung)

##### *Volatility-Swaps*

Ein Volatility-Swap ist eine Vereinbarung zwischen Gegenparteien über den Austausch regelmäßiger Zahlungen auf Basis der festgestellten Volatilität eines Referenztitels, eines Referenzindex, einer Referenzwährung oder einer anderen Referenzanlage über einen festgelegten Zeitraum. Einer der Cashflows basiert in der Regel auf der realisierten Volatilität der Referenzanlage, festgestellt anhand von Änderungen des Preises oder Kursniveaus dieser Anlage über den festgelegten Zeitraum, während der andere Cashflow auf einem spezifischen Satz basiert, der die zum Zeitpunkt der Ausführung des Swaps erwartete Volatilität der Referenzanlage oder die festgestellte Volatilität einer anderen Referenzanlage über den festgelegten Zeitraum repräsentiert. Der Wertzuwachs oder die Wertminderung eines Volatility-Swap ist in der Regel auf das Ausmaß der Volatilität der Referenzanlage bzw. den Umfang seiner Kursschwankungen während des festgelegten Zeitraums zurückzuführen und nicht auf allgemeine direktionale Kursbewegungen.

Volatility-Swaps sind ihrer Struktur nach weniger standardisiert als andere Arten von Swaps und bieten ein reines bzw. isoliertes Engagement bezogen auf das Volatilitätsrisiko der jeweils zugrunde liegenden Referenzanlage. Für gewöhnlich werden Volatility-Swaps eingesetzt, um auf künftige Schwankungsbreiten zu spekulieren, Transaktionen in Bezug auf den Spread zwischen realisierter und erwarteter Volatilität einzugehen oder das Volatilitätsrisiko der vom Portfolio gehaltenen Anlagen zu mindern.

##### *Variance-Swaps*

Variance-Swap-Kontrakte erstrecken sich auf eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis der gemessenen Varianz (d. h. des Quadrats der Volatilität) eines bestimmten Basiswerts. Eine Partei erklärt sich im Rahmen dieser Vereinbarung bereit, einen „festen Zinssatz“ oder eine Zahlung in Bezug auf den Ausübungspreis gegen einen „variablen Zinssatz“ oder eine realisierte Preisvarianz des Basiswerts in Bezug auf den Nominalwert zu tauschen. Bei Vertragsabschluss wird der Ausübungspreis in der Regel so festgelegt, dass der beizulegende Zeitwert des Swaps gleich Null ist. Folglich findet bei Vertragsbeginn keinerlei Zahlungsaustausch statt. Am Fälligkeitstag entspricht der von einer Partei an die andere zu zahlende Betrag der Differenz zwischen der realisierten Preisvarianz des Basiswerts und dem Ausübungspreis, multipliziert mit dem Nominalwert. Ein Empfänger der realisierten Preisvarianz hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Ein Zahler der realisierten Preisvarianz wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Bei dieser Art von Vereinbarung handelt es sich im Grunde genommen um einen Terminkontrakt auf die künftige realisierte Preisvarianz des Basiswerts.

##### *Correlation-Swaps*

Ein Correlation-Swap ist ein Kontrakt, bei dem der Optionskäufer die Differenz zwischen der beobachteten Korrelation und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt eines Korbs von Vermögenswerten erhält, dessen Entwicklung über einen bestimmten Zeitraum beobachtet wird. Der Correlation-Swap kann als Terminkontrakt auf die realisierte Korrelation gesehen werden. Sein Auszahlungsprofil besteht einfach in der Differenz zwischen der realisierten Korrelation über den angegebenen Zeitraum und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt, multipliziert mit dem Nominalwert des Kontrakts. Aufgrund der Beschaffenheit des Kontrakts ist die Auszahlung mit dem Näherrücken der Fälligkeit de facto bekannt, da alle Beobachtungen für die Berechnung der Korrelation de facto bekannt sind. Daher nimmt das Modellrisiko mit zunehmender Laufzeit des Vertrags ab. Bei einem ausstehenden Kontrakt muss die implizite Korrelation für alle zukünftigen Korrelationen berechnet werden, die als Marktpreis der zukünftigen Korrelation gesehen werden können. Die implizite Korrelation bzw. Korrelationsmarke lässt sich aus beobachteten Preisen für Correlation-Swaps oder aus Notierungen von OTC-Händlern ableiten.

#### Optionen

Optionskontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Schreibt ein Portfolio eine Option, wird der Betrag, der dem Portfolio erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit verbucht und anschließend der beizulegende Zeitwert der geschriebenen Option um diesen Betrag angepasst. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Kaufoptionen wird bei der Ermittlung des realisierten Gesamtgewinns oder -verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung hinzugerechnet. Die Prämie auf ausgeübte verkaufte Verkaufsoptionen wird von den Kosten für die erworbenen Wertpapiere, Indizes, Derivate oder Fremdwährungen abgezogen. Prämien aus geschriebenen Optionen, die verfallen, werden als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf gekaufte und ausgeübte Verkaufsoptionen wird bei Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlustes vom Verkaufserlös des Basiswerts bzw. der Basiswährung abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Kaufoptionen wird zu den Kosten des gekauften Wertpapiers, Index, Derivats bzw. der gekauften Währung addiert. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Optionen gezahlte Prämien werden als realisierte Verluste behandelt. Die Ausübungspreise für Optionen auf Aktienkörbe lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Wertpapierkörben.

#### Swaptions

Schreibt ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die dem Portfolio erhält, entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der geschriebenen Swaption angepasst. Erhaltene Prämien aus geschriebenen Swaptions, die unausgeübt verfallen, werden vom Portfolio an den Verfallsdaten als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Payer-Swaptions wird bei der Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Swaps hinzugerechnet. Wird eine geschriebene Receiver-Swaption ausgeübt, reduziert die Prämie die Kostenbasis des gekauften Swaps.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Swaptions (Fortsetzung)**

Kauft ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die der Portfolio gezahlt hat, entsprechender Betrag als Vermögenswert verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der gekauften Swaption angepasst. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Swaptions gezahlte Prämien werden am Verfallsdatum als realisierte Verluste behandelt. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Payer-Swaptions wird bei der Feststellung, ob das betreffende Portfolio einen realisierten Gewinn oder Verlust hat, von den Erlösen des zugrundeliegenden Swaps abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte Receiver-Swaptions wird zu der Kostenbasis der getauschten variabel verzinslichen Anlage addiert.

**Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte**

Das Portfolio kann umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es von einem Verkäufer Wertpapiere erwirbt (zum Beispiel eine Bank oder ein Wertpapierhändler), der zum Zeitpunkt des Verkaufs zustimmt, das Wertpapier zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen und somit die Rendite für das Portfolio während der Laufzeit des umgekehrten Pensionsgeschäft festlegt. Der Rückkaufpreis ist der Kaufpreis plus ein vereinbarter Marktzins, der nicht im Zusammenhang mit dem Zinssatz oder der Fälligkeit des gekauften Wertpapiers steht. Das Portfolio kann auch umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es ein Wertpapier verkauft und zustimmt, es zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen.

**Differenzkontrakte**

Differenzkontrakte werden zur Schlussnotierung des zugrundeliegenden Wertpapiers abzüglich der jedem Kontrakt zurechenbaren Finanzierungskosten (die separat verbucht werden), umgerechnet in die Basiswährung des Differenzkontrakts, bewertet. Der aktuelle Marktwert wird in der Bilanz ausgewiesen. Beim Eingehen von Differenzkontrakten kann ein Portfolio verpflichtet sein, dem Broker einen Geldbetrag und/oder andere Vermögenswerte in Höhe eines bestimmten Prozentsatzes des Kontraktwertes („Ersteinschuss“) als Sicherheit zu übertragen. Anschließend werden je nach den Wertschwankungen des zugrundeliegenden Wertpapiers regelmäßig so genannte „Nachschusszahlungen“ vom einem Portfolio geleistet bzw. entgegengenommen. Während der Laufzeit des Differenzkontrakts werden Wertänderungen des Kontrakts als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste anhand der Marktbewertungsmethode an jedem Bewertungstag erfasst, so dass der Wert des zugrundeliegenden Wertpapiers wiedergespiegelt wird. Bei Schließung des Kontrakts entsprechen die realisierten Gewinne oder Verluste der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung (einschließlich der Finanzierungskosten) und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung. Die Differenzkontrakten zuzurechnenden Dividenden (nach Abzug von Quellensteuern) werden als Dividendenforderungen oder -verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres verbucht.

**Saldierung von Finanzinstrumenten**

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

**Barmittel und Barmitteläquivalente**

Barmittel umfassen Sichtguthaben bei Banken. Barmitteläquivalente sind kurzfristige hochliquide Investitionen, die jederzeit in festgelegte Zahlungsmittelbeträge umgewandelt werden können, nur einem unwesentlichen Wertschwankungsrisiko unterliegen und zur Begleichung kurzfristiger Barverpflichtungen und nicht für Anlagezwecke oder andere Zwecke gehalten werden. Barmittel und Barmitteläquivalente werden zu ihrem Nennwert, gegebenenfalls einschließlich aufgelaufener Zinsen, am Bewertungszeitpunkt des jeweiligen Handelstages bewertet, es sei denn, nach Einschätzung der Direktoren (in Konsultation mit dem Manager und der Verwaltungsstelle) muss eine Anpassung vorgenommen werden, damit ihr tatsächlicher Wert reflektiert wird.

*Kassenbestände des Fonds*

Einige der Kassenbestände des Fonds werden gemäß den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies“ (Kassenbestände mit Zeichnungs- Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern) von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Diese Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) für den Fonds in Konten für nicht bearbeitete Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknamegelder und/oder sonstige an Anleger zahlbare Beträge gehalten und gelten als Vermögenswerte des Fonds. Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

**Forderungen von/gegenüber Brokern**

Die von den Portfolios an eine Gegenpartei im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Forderungen gegenüber Brokern ausgewiesen. Die von der Gegenpartei an ein Portfolio im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Verbindlichkeiten gegenüber Brokern ausgewiesen. Bareinschüsse werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

#### Währungsumrechnung

##### *Funktionale Währung und Darstellungswährung*

Die funktionale und die Darstellungswährung des Corporate Hybrid Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Euro Opportunistic Bond, des European High Yield Bond, des European Sustainable Equity, des Macro Opportunities FX und des Ultra Short Term Euro Bond ist der Euro. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des China A-Share Equity und des China Bond ist der CNY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des Japan Equity Engagement ist der JPY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung aller anderen Portfolios ist der US-Dollar. Da die Basiswährung des größten Teils des Nettovermögens des Fonds der US-Dollar ist, wird der US-Dollar als die am besten geeignete Konsolidierungswährung betrachtet. Weitere Einzelheiten hierzu sind in Anmerkung 15 enthalten

##### *Transaktionen und Salden*

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die funktionale Währung des Portfolios lauten, werden zu dem am Bilanzstichtag geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Transaktionen in anderen Währungen als der funktionalen Währung des Portfolios werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktion geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen werden bei der Ermittlung des Jahresergebnisses in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen.

Zeichnungsgelder und Beträge, die bei der Rücknahme rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile in anderen Währungen als der funktionalen Währung gezahlt werden, werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktionen geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Die Bilanz wird anhand der Wechselkurse zum Jahresende umgerechnet, und die Gewinn- und Verlustrechnung sowie die Aufstellung über die Entwicklung des Nettovermögens werden zum Durchschnittskurs des Jahres umgerechnet.

#### Verbuchung von Aufwand und Ertrag

Dividendenerträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung an dem Datum verbucht, an dem das betreffende Wertpapier „ex-Dividende“ notiert ist, soweit die entsprechende Information dem Portfolio in angemessener Weise zur Verfügung steht. Dividenden und Zinserträge werden vor Abzug von Quellensteuern ausgewiesen, die nicht zurückgefordert werden können und gesondert in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen werden, sowie nach Abzug von etwaigen Steuergutschriften. Zinsen aus Bankeinlagen werden auf Kassenbasis verbucht, während andere Erträge periodengerecht ausgewiesen werden.

Zinserträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung für alle Schuldinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, periodengerecht ausgewiesen.

#### Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen

Realisierte Gewinne und Verluste aus der Veräußerung von finanziellen Vermögenswerten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, werden auf einer „First in/First out“-Basis berechnet. Die damit verbundene Wechselkursbewegung zwischen dem Kauf- und dem Verkaufsdatum bei Veräußerung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wird in den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten einbezogen. Anlagetransaktionen werden am Handelstag verbucht, d. h. dem Tag, an dem das Portfolio sich verpflichtet, den entsprechenden Vermögenswert zu kaufen oder zu verkaufen.

#### Besteuerung

Gemäß geltendem Recht und den branchenüblichen Usancen ist der Fonds als Investmentgesellschaft im Sinne von Section 739B(1) des Taxes Consolidation Act von 1997 (Gesetz zur Steuerkonsolidierung), in seiner aktuellen Fassung, anerkannt. Dementsprechend sind seine relevanten Erträge oder Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Jedoch können dem Fonds beim Eintreten eines Steuertatbestands irische Steuern entstehen.

Ein Steuertatbestand umfasst Ausschüttungszahlungen an Anteilhaber oder die Einlösung, Rücknahme oder Übertragung von Anteilen sowie das Halten von Anteilen am Ende eines jeden Achtjahreszeitraums, beginnend mit dem Erwerb der Anteile. Bei Steuertatbeständen werden für den Fonds keine irischen Steuern fällig bei:

- (i) einem Anteilhaber, der weder irischer Staatsbürger ist noch im Sinne des Steuerrechts zum Zeitpunkt des Steuertatbestands als in Irland ansässig gilt, vorausgesetzt, er hat die entsprechenden gültigen Erklärungen gemäß den Richtlinien des Taxes Consolidation Act von 1997 in der jeweils gültigen Fassung beim Fonds eingereicht, und
- (ii) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anteilhaber, die beim Fonds die notwendigen unterzeichneten Erklärungen eingereicht haben.

In diesem Berichtszeitraum lagen keine Steuertatbestände vor.

Etwasige Veräußerungsgewinne, Dividenden und Zinsen, welche der Fonds durch seine Wertpapiere erzielt, können ggf. Quellensteuern der Länder unterliegen, aus denen diese Erträge/Gewinne erzielt werden, und diese Steuern können vom Fonds oder seinen Anteilhabern ggf. nicht wiedererlangt werden.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Besteuerung (Fortsetzung)**

Der Finance Act von 2010 sieht vor, dass die Steuerbehörden Investmentfonds, die außerhalb Irlands vermarktet werden, die Genehmigung erteilen können, Zahlungen an nicht in Irland ansässige Anleger ohne Abzug der irischen Steuer zu leisten, wenn keine maßgebliche Erklärung vorliegt, sofern „äquivalente Maßnahmen“ getroffen werden. Ein Fonds, der diese Genehmigung erhalten will, muss diese schriftlich bei den Steuerbehörden beantragen und die Erfüllung der maßgeblichen Bedingungen bestätigen. Die Gesellschaft hatte zum 31. Dezember 2022 und 2021 keinen Antrag auf Genehmigung bei der Revenue Commission gestellt.

Die Gesellschaft hat die Steuerposition für die offenen Steuerjahre zum 31. Dezember 2022 und 2021 überprüft und entschieden, dass keine Rückstellung für Ertragssteuern und/oder ungewisse Steuerpositionen im Abschluss der Gesellschaft erforderlich ist.

Es bestehen Unsicherheiten hinsichtlich der Auslegung komplexer Steuervorschriften und steuerrechtlicher Änderungen in Bezug auf ausländische Quellensteuern. Angesichts des breiten Spektrums an internationalen Anlagen könnten Differenzen, die sich zwischen tatsächlichen Investmenterträgen und den getroffenen Annahmen ergeben, oder künftige Änderungen an derartigen Annahmen weitere Berichtigungen des bereits erfassten Steueraufwands erfordern.

Der Fonds bildet auf der Grundlage angemessener Schätzungen Rückstellungen für die potenziellen Folgen von Prüfungen durch die Steuerbehörden der jeweiligen Länder, in denen er investiert. Die Höhe derartiger Rückstellungen richtet sich nach verschiedenen Faktoren wie Erfahrungen aus früheren Steuerprüfungen und abweichenden Auslegungen der Steuervorschriften durch das steuerpflichtige Unternehmen und die zuständige Steuerbehörde. Derartige unterschiedliche Auslegungen können sich zu vielen verschiedenen Fragen ergeben, je nach der vorliegenden Situation im Domizilland der jeweiligen Anlage. Da der Fonds die Wahrscheinlichkeit von Rechtsstreitigkeiten und anschließenden Abflüssen von Zahlungsmitteln im Hinblick auf Steuern als gering erachtet, wurde keine Eventualverbindlichkeit ausgewiesen.

**Rückzahlbare, gewinnberechtigende Anteile**

Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile sind auf Wunsch der Anteilhaber zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten eingestuft. Ausschüttungen auf diese Anteile werden in der Gewinn- und Verlustrechnung unter Finanzierungskosten ausgewiesen. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile können an jedem Handelstag gegen einen Barbetrag an das Portfolio zurückgegeben werden, der ihrem anteiligen Wert am NIW des Portfolios entspricht. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile werden zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Bilanzstichtag zahlbar wäre, wenn der Anteilhaber von seinem Recht auf Rückgabe des Anteils an das Portfolio Gebrauch gemacht hätte.

**Ausschüttungspolitik**

Die Direktoren haben beschlossen, sämtliche Nettoerträge und realisierten Nettokapitalgewinne, die den thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, wiederanzulegen, und sie beabsichtigen daher nicht, für Anteile dieser Klassen Dividenden festzusetzen.

*Quelle der Ausschüttungen*

Satzungsgemäß können die Direktoren Dividenden auf Anteile aus den Nettoerträgen (einschließlich Dividendenerträge und Zinserträge) und/oder dem Überschuss aus realisierten und nicht realisierten Gewinnen nach Abzug der realisierten und nicht realisierten Verluste aus den Anlagen des Fonds (gemeinsam „Nettoertrag“) und auch aus dem Kapital beschließen. Dividenden, die aus dem Kapital gezahlt werden, kommen einer Rückzahlung oder Entnahme eines Teils der ursprünglichen Anlage eines Anteilhabers oder aus Kapitalerträgen, die dieser ursprünglichen Anlage zuzurechnen sind, gleich. Solche Dividenden können unmittelbar zu einem Rückgang des NIW der betreffenden Anteile führen.

Die Direktoren beabsichtigen derzeit, vorbehaltlich einer „de-minimis“-Grenze, mindestens 85 % der Nettoerträge, die jeder ausschüttenden Klasse zurechenbar sind, als Dividende festzusetzen und auszuschütten; ausgenommen sind hiervon (i) die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, (ii) die (monatlich) ausschüttenden Klassen, (iii) die (CG) ausschüttenden Klassen und (iv) alle sonstigen ausschüttenden Klassen in einem Portfolio, die laut dem maßgeblichen Prospektzusatz Dividenden aus Kapital und Nettoertrag ausschütten. Die Anteilhaber sollten jedoch beachten, dass die Direktoren sich in Bezug auf eine ausschüttende Klasse in ihrem eigenen Ermessen für oder gegen eine solche Festsetzung und Ausschüttung entscheiden können.

Im Bezug auf die monatlich ausschüttenden Klassen, die wöchentlich ausschüttenden Klassen und die (CG) ausschüttenden Klassen beabsichtigen die Direktoren, eine den Anteilen dieser Klassen zuweisbare, (wie zutreffend) monatliche, wöchentliche oder halbjährliche Dividende festzusetzen und zu zahlen; dies geschieht durch eine Kombination aus Nettoertrag und Kapital, so dass, falls der Nettoertrag für den entsprechenden Zeitraum weniger als der festgesetzte Betrag ist, die Differenz aus dem die betreffenden Anteile repräsentierenden Kapital gezahlt wird, was es den Klassen ermöglicht, regelmäßige, feste Dividenden auszuschütten. Falls die Nettoeinkünfte, die den (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, den (monatlich) ausschüttenden Klassen oder den (CG) ausschüttenden Klassen zuzuschreiben sind, den Betrag übersteigen, der während des entsprechenden Zeitraums erklärt wurde, wird der Betrag der Nettoeinkünfte, der diesen Betrag übersteigt, in einem Ausschüttungskonto für die jeweiligen Anteile gehalten und bildet Teil der Dividende, die für spätere Ausschüttungszeiträume zu zahlen ist. Vorstehendes gibt die derzeitige Absicht der Direktoren bezüglich der Festsetzung und Zahlung von Dividenden für die (monatlich) ausschüttenden Klassen und die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen wieder. Die Direktoren können sich jedoch in ihrem eigenen Ermessen gegen eine solche Festsetzung und Zahlung entscheiden, und es gibt keine Garantie dafür, dass solche Dividenden gezahlt werden.



**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)**

**Ausschüttungspolitik (Fortsetzung)**

*Ausschüttungshäufigkeit*

Unter normalen Umständen beabsichtigen die Direktoren, die Dividenden wie folgt zu zahlen:

- (a) Bei allen (wöchentlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag einer jeden Woche erklärt und gezahlt;
- (b) Bei allen (monatlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und drei Geschäftstage später gezahlt;
- (c) bei allen (CG) ausschüttenden Klassen aller Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf halbjährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (d) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des China Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Euro Opportunistic Bond, des Global Equity Megatrends und des Ultra Short Term Euro Bond werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das vorhergehende Quartal gezahlt;
- (e) bei jeder der ausschüttenden Klassen des CLO Income, des Commodities, des Corporate Hybrid Bond, the Emerging Market Debt - Hard Currency, the Emerging Market Debt - Local Currency, des Emerging Market Debt Blend, des Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend, des European High Yield Bond, des Event Driven, des Global Bond, des Global Diversified Income FMP – 2024, des Global Flexible Credit Income, des Global High Yield SDG Engagement, des Global High Yield Sustainable Action, des Global Investment Grade Credit, des Global Opportunistic Bond, des Global Real Estate Securities, des High Yield Bond, des Multi-Asset Income, des Short Duration Emerging Market Debt, des Short Duration High Yield SDG Engagement, des Strategic Income, des Sustainable Asia High Yield, des Sustainable Emerging Market Corporate Debt, des Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency, des US Equity Index PutWrite und des US Real Estate Securities werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;
- (f) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des US Long Short Equity ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden halbjährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (g) Ausschüttungen der anderen ausschüttenden Klassen des Next Generation Space Economy, des Uncorrelated Strategies, des XXXXXXXXXXXXX, des US Equity, des US Large Cap Value, des US Multi Cap Opportunities, des US Small Cap und des US Small Cap Intrinsic Value werden jährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt; und
- (h) bei allen anderen ausschüttenden Klassen aller anderen Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf jährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das am vorhergehenden 31. Dezember abgelaufene Kalenderjahr gezahlt werden;
- (i) Bei allen (monatlich) Bruttoerträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und innerhalb von drei Geschäftstagen gezahlt; und
- (j) bei allen übrigen (Brutto-)Erträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden auf vierteljährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt.

Unter dem Vorbehalt, dass Erträge zur Ausschüttung zur Verfügung stehen, können die Direktoren auch beschließen, für jede der ausschüttenden Klassen Zwischendividenden festzusetzen und auszuschütten. Alle Anteile einer ausschüttenden Klasse, die an einem Datum, an dem die Direktoren beschließen, für diese ausschüttende Klasse eine Dividende festzusetzen, ausgegeben sind, haben Anspruch auf diese Dividende.

Die Direktoren behalten sich das Recht vor, die Dividendenpolitik jeder Anteilklasse nach ihrem eigenen Ermessen ohne vorherige Mitteilung an die Anteilhaber der betreffenden Klasse zu ändern. Jede Dividende, die nicht innerhalb eines Zeitraums von sechs Jahren ab dem Datum des Dividendenbeschlusses in Anspruch genommen wird, verjährt und fällt dem jeweiligen Portfolio wieder zu.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET

	5G Connectivity		Absolute Return Multi Strategy*	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Aktien	952.894.719	2.328.090.567	6.766	31.388
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	12.141.765	1.155.281	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>965.036.484</b>	<b>2.329.245.848</b>	<b>6.766</b>	<b>31.388</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	–	–	(11.507)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(3.280.059)	(5.949.073)	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(3.280.059)</b>	<b>(5.949.073)</b>	<b>–</b>	<b>(11.507)</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Asian Debt – Hard Currency		China A–Share Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert CNY	Zeitwert CNY
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Unternehmensanleihen	18.090.069	12.557.968	–	–
Aktien	–	–	15.317.693	23.719.184
Staatsanleihen	2.090.986	1.499.303	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	47.079	16.283	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	34.382	12.320	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	6.312	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>20.262.516</b>	<b>14.092.186</b>	<b>15.317.693</b>	<b>23.719.184</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(3.440)	(25.555)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(84.733)	(9.164)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(1.404)	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(88.173)</b>	<b>(36.123)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	China Bond		China Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert CNY	Zeitwert CNY	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Einlagenzertifikate	92.924.345	38.863.400		
Unternehmensanleihen	272.165.839	385.785.879	–	–
Aktien	–	–	306.849.688	503.367.414
Staatsanleihen	60.073.670	119.228.610	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	3.921.557	2.173.424	1.099.861	196.873
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>429.085.411</b>	<b>546.051.313</b>	<b>307.949.549</b>	<b>503.564.287</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(37.837)	(414.680)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(2.701.843)	(2.788.624)	(817.712)	(268.158)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(2.739.680)</b>	<b>(3.203.304)</b>	<b>(817.712)</b>	<b>(268.158)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	CLO Income		Commodities <sup>1</sup>
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Agency Bonds	–	–	10.530.836
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	112.870.953	133.274.949	–
Unternehmensanleihen	–	–	26.223.262
Schatzwechsel	–	–	39.453.874
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	3.267.421	60.610	1.519.496
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	92.446	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>116.138.374</b>	<b>133.428.005</b>	<b>77.727.468</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(989.846)	(698.215)	(333.046)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	(334.323)	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.324.169)</b>	<b>(698.215)</b>	<b>(333.046)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Corporate Hybrid Bond		Diversified Currency*
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	EUR	EUR	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Unternehmensanleihen	1.638.001.345	2.250.494.338	–
Investmentfonds	10.317.170	11.305.839	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	36.511.573	13.732.395	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.684.830.088</b>	<b>2.275.532.572</b>	<b>–</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(37.445.575)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(20.223.334)	(15.718.355)	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(57.668.909)</b>	<b>(15.718.355)</b>	<b>–</b>

\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Emerging Market Debt – Hard Currency		Emerging Market Debt – Local Currency	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Einlagenzertifikat	–	–	18.492.177	–
Unternehmensanleihen	784.977.470	1.162.113.940	22.468.723	33.373.484
Staatsanleihen	1.508.020.941	2.239.293.074	1.280.353.016	1.796.211.686
Investmentfonds	16.110.000	16.683.000	15.136.550	16.157.350
Schatzwechsel	–	–	–	86.921.689
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	23.148.647	14.326.208	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	12.379.899	12.483.572	14.987.459	16.632.554
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	1.909.636	–	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	–	8.845.584	15.018.402
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>2.346.546.593</b>	<b>3.444.899.794</b>	<b>1.360.283.509</b>	<b>1.964.315.165</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.308.787)	(640.953)	(676.393)	(156.313)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(10.560.096)	(1.972.040)	(9.665.447)	(7.881.956)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	–	(47.106.454)	(54.766.239)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(11.868.883)</b>	<b>(2.612.993)</b>	<b>(57.448.294)</b>	<b>(62.804.508)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Emerging Market Debt Blend		Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	
	Zum 31. Dezember 2022 Zeitwert US\$	Zum 31. Dezember 2021 Zeitwert US\$	Zum 31. Dezember 2022 Zeitwert US\$	Zum 31. Dezember 2021 Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Unternehmensanleihen	149.902.253	299.501.688	7.512.041	9.721.900
Staatsanleihen	288.112.593	555.754.753	42.285.874	31.953.570
Investmentfonds	13.380.558	16.177.245	–	–
Schatzwechsel	–	14.114.927	–	1.676.064
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.175.800	1.490.898	610.127	258.703
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	4.031.358	5.585.915	446.879	606.096
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	1.658.685	–	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	4.841.085	4.950.107	43.385	27.541
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>463.102.332</b>	<b>897.575.533</b>	<b>50.898.306</b>	<b>44.243.874</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(159.705)	(93.022)	(65.989)	(10.209)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(2.058.976)	(1.951.949)	(340.697)	(96.215)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(11.561.405)	(13.631.259)	(135.722)	(170.977)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(13.780.086)</b>	<b>(15.676.230)</b>	<b>(542.408)</b>	<b>(277.401)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Emerging Markets Equity		Emerging Markets Select Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Aktien	188.734.006	377.959.320	90.426.979	123.167.159
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1.053.813	478.323	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>189.787.819</b>	<b>378.437.643</b>	<b>90.426.979</b>	<b>123.167.159</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(666.859)	(688.813)	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(666.859)</b>	<b>(688.813)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Euro Bond Absolute Return		Euro Opportunistic Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert EUR	Zeitwert EUR	Zeitwert EUR	Zeitwert EUR
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	2.319.216	2.053.891	462.816	298.264
Unternehmensanleihen	23.938.251	17.300.482	4.079.176	4.427.757
Staatsanleihen	19.650.553	29.296.725	4.005.023	5.718.588
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.497.736	434.145	41.432	28.229
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	39.745	221.198	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	61.989	73.191	93	19.730
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	12.884	108.483	1.858	3.311
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>47.520.374</b>	<b>49.488.115</b>	<b>8.590.398</b>	<b>10.495.879</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(103.516)	(21.403)	(82.010)	(3.370)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(1.032.074)	(13.326)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	(67.569)	–	–	–
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	(32.637)	(472.208)	(6.528)	(106.247)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(43.820)	(11.906)	(23.909)	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.279.616)</b>	<b>(518.843)</b>	<b>(112.447)</b>	<b>(109.617)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	European High Yield Bond		European Sustainable Equity <sup>2</sup>	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert EUR	Zeitwert EUR	Zeitwert EUR	Zeitwert EUR
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	215.121	219.984	–	–
Unternehmensanleihen	32.065.000	36.562.368	–	–
Aktien	–	–	174.388.827	110.416.942
Mittelfristige Schuldverschreibungen	202.519	211.251	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1.258.544	777.070	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>33.741.184</b>	<b>37.770.673</b>	<b>174.388.827</b>	<b>110.416.942</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(3.113.019)	(320.550)	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(3.113.019)</b>	<b>(320.550)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Event Driven <sup>1</sup> Zum 31. Dezember 2022 Zeitwert US\$	Global Bond Zum 31. Dezember 2022 Zeitwert US\$	Zum 31. Dezember 2021 Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Agency Bonds	–	2.423.190	2.795.723
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	8.861.707	15.793.186
Unternehmensanleihen	–	44.359.194	52.968.088
Staatsanleihen	–	53.670.009	82.196.271
Mortgage-Backed Securities	–	19.062.981	18.239.492
Kommunalanleihen	–	1.706.806	–
Schatzwechsel	33.823.354	791.814	1.399.195
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	270.257	34.796
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	918.069	2.638.428	1.109.117
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	1.233	6.541
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	18.364	–	77.785
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>34.759.787</b>	<b>133.785.619</b>	<b>174.620.194</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	(191.230)	(387.582)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(18.616)	(1.908.377)	(779.807)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(13.185)	–
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	–	(28.500)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(18.616)</b>	<b>(2.112.792)</b>	<b>(1.195.889)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Diversified Income FMP – 2024		Global Equity Index PutWrite*	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2021	
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Unternehmensanleihen	150.336.737	206.932.749		–
Staatsanleihen	3.931.136	11.000.752		–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	523.987	23.493		–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>154.791.860</b>	<b>217.956.994</b>		<b>–</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(417)	(76.865)		–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(417)</b>	<b>(76.865)</b>		<b>–</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Equity Megatrends		Global Flexible Credit Income	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	–	24.079.041	18.193.868
Unternehmensanleihen	–	–	316.164.124	580.860.589
Aktien	79.465.335	81.955.406	5.247.334	–
Staatsanleihen	–	–	9.817.787	12.778.898
Investmentfonds	–	–	338.564	474.751
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	468.202	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	–	29.033.515	1.927.621
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	–	–	588.178
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	–	–	214.191
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>79.465.335</b>	<b>81.955.406</b>	<b>385.148.567</b>	<b>615.038.096</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Verkaufte Swaptionen	–	–	–	(4.894)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	(515.955)	(2.372.969)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	–	(10.857.921)	(3.100.807)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	–	(632.100)	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(12.005.976)</b>	<b>(5.478.670)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global High Yield SDG Engagement		Global High Yield Sustainable Action	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	US\$	US\$	US\$	US\$
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	1.002.292	–	–
Unternehmensanleihen	273.005.334	37.832.101	14.443.671	16.768.836
Mittelfristige Schuldverschreibungen	1.013.476	–	95.881	54.859
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	12.873.530	617.850	7.620	69.215
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	13.411	–	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>286.905.751</b>	<b>39.452.243</b>	<b>14.547.172</b>	<b>16.892.910</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(9.426.254)	(951.937)	(358.029)	(10.258)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(9.426.254)</b>	<b>(951.937)</b>	<b>(358.029)</b>	<b>(10.258)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>		Global Opportunistic Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Agency Bonds	–	–	307.820	406.473
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	–	4.290.102	10.807.801
Unternehmensanleihen	80.767.363	96.444.446	35.431.699	43.655.885
Staatsanleihen	2.758.010	–	24.711.043	25.468.905
Investmentfonds	–	–	1.801.216	5.754.344
Mortgage-Backed Securities	–	–	10.458.233	6.090.483
Schatzwechsel	–	–	–	3.123.203
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	568.616	199.754
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	16.124	464.848	2.069.747	1.282.810
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	–	455.060	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	–	17.416	52.876
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>83.541.497</b>	<b>96.909.294</b>	<b>80.110.952</b>	<b>96.842.534</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	(607.164)	(312.561)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(1.642.819)	(9.663)	(4.857.533)	(832.806)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	–	(64.729)	(1.634.210)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	–	(141)	(66.303)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.642.819)</b>	<b>(9.663)</b>	<b>(5.529.567)</b>	<b>(2.845.880)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Real Estate Securities		Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Aktien	6.846.055	7.549.758	130.524.482	202.536.546
Immobilienaktiengesellschaften	30.360.798	43.106.300	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	866.015	13.335	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>38.072.868</b>	<b>50.669.393</b>	<b>130.524.482</b>	<b>202.536.546</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(147.763)	(201.281)	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(147.763)</b>	<b>(201.281)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	High Yield Bond		InnovAsia 5G <sup>2</sup>	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	21.830.306	43.351.226	–	–
Unternehmensanleihen	1.982.553.426	2.791.815.047	–	–
Aktien	–	–	13.872.508	25.845.314
Investmentfonds	18.294.706	35.876.632	–	–
Mittelfristige Schuldverschreibungen	91.635.501	167.447.462	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	55.707.544	6.339.440	453.339	40.740
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	658.095	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>2.170.021.483</b>	<b>3.045.487.902</b>	<b>14.325.847</b>	<b>25.886.054</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(25.192.706)	(25.945.509)	(78.732)	(150.621)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	(404.963)	–	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(25.597.669)</b>	<b>(25.945.509)</b>	<b>(78.732)</b>	<b>(150.621)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Japan Equity Engagement		Macro Opportunities FX	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	JPY	JPY	EUR	EUR
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Unternehmensanleihen	–	–	24.967.521	42.828.912
Aktien	20.207.455.300	13.395.215.072	–	–
Staatsanleihen	–	–	2.778.639	200.575
Schatzwechsel	–	–	4.389.983	2.209.782
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	44.531.344	752.199	3.617.207	1.924.532
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>20.251.986.644</b>	<b>13.395.967.271</b>	<b>35.753.350</b>	<b>47.163.801</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(141.215.249)	(225.405)	(4.428.576)	(2.717.109)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(141.215.249)</b>	<b>(225.405)</b>	<b>(4.428.576)</b>	<b>(2.717.109)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Multi-Asset Income		Multi-Style Premia* Zum 31. Dezember 2021
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Agency Bonds	7.644	–	–
Unternehmensanleihen	4.880.908	8.797.485	–
Aktien	2.848.448	6.215.747	–
Staatsanleihen	311.601	1.293.771	–
Investmentfonds	602.185	1.484.544	–
Immobilienaktiengesellschaften	364.808	1.488.419	–
Participatory Notes	–	–	–
Gekaufte Optionskontrakte	4.207	2.984	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	51.032	16.478	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	160.435	148.411	–
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	2.121	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>9.231.268</b>	<b>19.449.960</b>	<b>–</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Verkaufte Optionskontrakte	(59.717)	(19.541)	–
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(2.994)	(9.844)	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(584.335)	(90.067)	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(647.046)</b>	<b>(119.452)</b>	<b>–</b>

\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Next Generation Mobility		Next Generation Space Economy <sup>1</sup>	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Aktien	136.877.785	203.565.859		7.981.674
Immobilienaktiengesellschaften	1.522.531	–		–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	294.328	8.780		–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>138.694.644</b>	<b>203.574.639</b>		<b>7.981.674</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(213.661)	(107.390)		–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(213.661)</b>	<b>(107.390)</b>		<b>–</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Short Duration Emerging Market Debt		Short Duration High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Unternehmensanleihen	3.527.685.607	4.774.728.985	477.638.711	561.613.956
Staatsanleihen	1.205.827.702	1.784.869.281	–	–
Investmentfonds	70.347.000	72.849.100	1.221.039	2.288.465
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	–	23.578.927	46.278.962
Schatzwechsel	51.075.667	–	10.810.063	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	46.700.064	21.429.031	23.012.144	1.240.239
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>4.901.636.040</b>	<b>6.653.876.397</b>	<b>536.260.884</b>	<b>611.421.622</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1.843.240)	–	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(23.986.773)	(17.737.158)	(5.286.451)	(5.381.257)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(25.830.013)</b>	<b>(17.737.158)</b>	<b>(5.286.451)</b>	<b>(5.381.257)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Strategic Income		Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Agency Bonds	772.053	1.038.942	–	–
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	105.467.359	75.102.043	–	–
Unternehmensanleihen	637.567.177	573.071.433	27.495.016	20.977.042
Staatsanleihen	243.357.365	283.764.634	837.924	1.236.942
Investmentfonds	58.225.837	65.268.964	–	–
Kommunalanleihen	20.744.098	17.076.840	–	–
Mortgage-Backed Securities	346.893.475	261.330.721	–	–
Mittelfristige Schuldverschreibungen	579.804	99.300.565	–	–
Schatzwechsel	8.017.122	190.052.290	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	2.904.814	650.292	13.122	2.187
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	29.520.687	2.641.510	282.337	–
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	25.894	1.454.679	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	451.266	107.813	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	821.049	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.454.526.951</b>	<b>1.571.681.775</b>	<b>28.628.399</b>	<b>22.216.171</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Strategic Income (Fortsetzung)		Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup> (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.425.842)	(4.547.280)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(7.161.491)	(5.071.083)	(29.229)	–
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	(97.587)	–	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(916.187)	(328.905)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	(3.863.949)	–	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(13.465.056)</b>	<b>(9.947.268)</b>	<b>(29.229)</b>	<b>–</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Sustainable Emerging Market Corporate Debt		Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency <sup>1</sup>
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Unternehmensanleihen	86.982.672	138.004.155	7.708.197
Staatsanleihen	4.401.408	2.837.365	136.106.159
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	49.937	88.548	2.512.729
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	853.222	501.625	1.237.337
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	–	53.826
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>92.287.239</b>	<b>141.431.693</b>	<b>147.618.248</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(7.617)	–	(46.430)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(134.345)	(45.258)	(862.058)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(141.962)</b>	<b>(45.258)</b>	<b>(908.488)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Systematic Global Sustainable Value		Ultra Short Term Euro Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert EUR	Zeitwert EUR
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	–	72.343.961	146.158.777
Unternehmensanleihen	–	–	670.503.994	828.802.596
Aktien	46.960.389	18.834.959	–	–
Staatsanleihen	–	–	56.450.113	62.415.148
Investmentfonds	–	1.618.552	–	–
Immobilienaktiengesellschaften	755.437	347.198	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	9.402.701	3.514.679
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	–	9.296	598.353
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	125.312	29.635	232.108	1.198.442
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>47.841.138</b>	<b>20.830.344</b>	<b>808.942.173</b>	<b>1.042.687.995</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	(1.719.108)	(31.300)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(90.456)	(40.232)	(6.570.781)	(228.659)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	–	(543.950)	(3.895.716)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	–	(1.735.988)	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(90.456)</b>	<b>(40.232)</b>	<b>(10.569.827)</b>	<b>(4.155.675)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Uncorrelated Strategies		XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Unternehmensanleihen	161.387.060	119.867.609	13.221.435
Aktien	135.368.028	16.510.711	16.089.324
Immobilienaktiengesellschaften	4.976.282	–	3.946.436
Participatory Notes	21.440	12.737	–
Staatsanleihen	4.218.750	11.177.787	–
Investmentfonds	–	10.302.696	–
Schatzwechsel	1.582.793.462	859.959.488	449.200.010
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	78.118.012	130.231.387	13.934.583
Gekaufte Optionskontrakte	202.760.196	251.415.148	35.858.570
Gekaufte Swaptions	1.388.392	343.188	68.848
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	40.643.851	17.116.984	8.521.839
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	212.294.005	23.765.615	54.485.356
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	3.899.449	4.357.573	678.244
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	700.944	251.024	–
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	971.550	2.115.159	319.127
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	32.121.676	4.495.645	1.343.255
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	65.682.162	9.827.741	1.024.404
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	27.160.802	–	–
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	1.435.658	148.731	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>2.555.941.719</b>	<b>1.461.899.223</b>	<b>598.691.431</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)		XXXXXXXXXXXXX <sup>1</sup> (Fortsetzung)
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>			
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	(58.716.225)	(98.493.951)	(3.269.736)
Verkaufte Optionskontrakte	(309.983.118)	(366.022.985)	(42.460.180)
Verkaufte Swaptionen	(708.024)	–	(20.738)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(25.288.052)	(34.573.502)	(4.922.598)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(37.812.332)	(40.945.220)	(6.317.151)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(23.945.145)	(12.213.481)	(1.000.582)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	(26.861.904)	–	–
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	(526.998)	(508.312)	(47.926)
Nicht realisierter Verlust aus Correlation-Swap-Kontrakten	(60.576)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten	(421.247)	(281.430)	(332.219)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	(4.417.825)	(5.714.671)	(939.941)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	(1.242.422)	(6.121.436)	(13.154)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(489.983.868)</b>	<b>(564.874.988)</b>	<b>(59.324.225)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Equity		US Equity Index PutWrite	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Aktien	27.005.260	8.236.976	–	–
Staatsanleihen	–	–	632.264.076	392.089.074
Immobilienaktiengesellschaften	478.769	141.214	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	2.158.080	–	16.592.327	1.075.693
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>29.642.109</b>	<b>8.378.190</b>	<b>648.856.403</b>	<b>393.164.767</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Verkaufte Optionskontrakte	–	–	(12.932.325)	(3.669.788)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(546.931)	–	(1.350.871)	(155.752)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(546.931)</b>	<b>–</b>	<b>(14.283.196)</b>	<b>(3.825.540)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Large Cap Value <sup>2</sup>		US Long Short Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$	Zeitwert US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Unternehmensanleihen	–	–	8.400.448	5.922.382
Aktien	1.688.625.847	2.024.667	158.010.330	407.697.481
Participatory Notes	–	–	3.750	9.330
Immobilienaktiengesellschaften	–	19.361	1.744.930	3.613.606
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	–	3.162.728	1.759.585
Gekaufte Optionskontrakte	–	–	–	177.671
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	470.254	6.956
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	973.737	–	6.686.844	304.263
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	–	664.406	700.627
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.689.599.584</b>	<b>2.044.028</b>	<b>179.143.690</b>	<b>420.191.901</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	–	(1.291.811)	(2.294.957)
Verkaufte Optionskontrakte	–	–	(74.360)	(183.415)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	–	(769.254)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(102.612)	–	(822.791)	(4.166.530)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	–	(700.901)	(13.725.414)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(102.612)</b>	<b>–</b>	<b>(2.889.863)</b>	<b>(21.139.570)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Multi Cap Opportunities		US Real Estate Securities	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Aktien	439.025.865	781.762.992	–	16.391.963
Immobilienaktiengesellschaften	–	–	624.531.489	998.183.643
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	2.736.142	427.087	4.089.640	789.444
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>441.762.007</b>	<b>782.190.079</b>	<b>628.621.129</b>	<b>1.015.365.050</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(587.402)	(1.041.858)	(1.230.032)	(3.778.536)
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(587.402)</b>	<b>(1.041.858)</b>	<b>(1.230.032)</b>	<b>(3.778.536)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Small Cap		US Small Cap Intrinsic Value	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Unternehmensanleihen	–	–	–	22.652
Aktien	578.779.674	812.011.348	184.718.734	141.240.874
Immobilienaktiengesellschaften	–	–	2.170.638	1.318.782
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	949.457	191.707	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>579.729.131</b>	<b>812.203.055</b>	<b>186.889.372</b>	<b>142.582.308</b>
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(236.699)	(653.133)	–	–
<b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>(236.699)</b>	<b>(653.133)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE

Alle Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman & Co. oder bei vom Fonds genehmigten Drittinstituten als Tagesgeldeinlagen oder direkt bei einer Unterdepotbank gehalten. In den nachfolgenden Tabellen ist das Risiko aufgeführt, dem der Fonds durch die aufgeführten Institute mit seinen Bareinlagen am 31. Dezember 2022 und am 31. Dezember 2021 ausgesetzt war.

	5G Connectivity		Absolute Return Multi Strategy*		Asian Debt – Hard Currency	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	5	–	3.884	–	–	–
Bank of Montreal, London	–	–	–	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	–	3.884	–	–	151.185
BBH, Grand Cayman	2	1	63.136	6	–	–
BNP Paribas, Paris	–	–	–	10.417	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	95.330	7.167.595	337	66	6.508	556
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto	–	–	–	–	–	–
Citibank, New York	34.022.865	–	2.651	–	1.173.705	–
Credit Suisse AG, Zurich	–	–	–	1.432	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	402	5.432	–	–	–	–
JPMorgan Chase, New York	–	–	3.884	–	–	–
National Australia Bank, London	–	–	3.751	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	85.561.455	3.884	–	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	5	3.884	67.556	–	–
Sumitomo, Tokyo	1.050	802	3.884	–	48	–
<b>Insgesamt</b>	<b>34.119.654</b>	<b>92.735.290</b>	<b>93.179</b>	<b>79.477</b>	<b>1.180.261</b>	<b>151.741</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	China A–Share Equity		China Bond		China Equity	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 CNY	Zum 31. Dezember 2021 CNY	Zum 31. Dezember 2022 CNY	Zum 31. Dezember 2021 CNY
ANZ Bank, London	–	–	–	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	–	–	7.630.860	–	–
BBH, Grand Cayman	–	–	4	2	–	6.597.070
Brown Brothers Harriman & Co	947.616	762.665	22.349.396	20.793.773	2.089.537	11.630.096
Citibank, New York	–	–	437.578	–	346.391	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	4.836	1.436	–	–	6.109.128	8.884.997
JPMorgan Chase, New York	478	–	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	–	–	1.546.378	–	671.604
Sumitomo, Tokyo	–	–	1.979	284	–	–
<b>Insgesamt</b>	<b>952.930</b>	<b>764.101</b>	<b>22.788.957</b>	<b>29.971.297</b>	<b>8.545.056</b>	<b>27.783.767</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	CLO Income		Commodities <sup>1</sup>		Corporate Hybrid Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR	EUR
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	10.474.348	–	–	–	40.130.348
Barclays Bank, London	–	–	–	–	21.252.082	2
BBH, Grand Cayman	–	–	–	–	1	1
BNP Paribas, Paris	–	–	–	–	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	44.379	107	46.258	–	297.452	127
Citibank, New York	9.657.697	–	5.975.120	–	–	–
JPMorgan Chase, New York	984.125	–	–	–	83.168.999	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	3.721.092	2.073.620	–	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	9.657.697	–	–	–	–	–
Sumitomo, Tokyo	5.897	10.474.348	–	–	20.246.629	131.784.664
<b>Insgesamt</b>	<b>20.349.795</b>	<b>24.669.895</b>	<b>8.094.998</b>	<b>–</b>	<b>124.965.163</b>	<b>171.915.142</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Diversified Currency*		Emerging Market Debt – Hard Currency		Emerging Market Debt – Local Currency	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
ANZ Bank, London	–	8	–	50.755.425	–	–
Bank of Montreal, London	–	8	–	5.718.310	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	8	17.665.809	–	788	838
BBH, Grand Cayman	–	19.530	1	–	–	1
BNP Paribas, Paris	–	8	–	–	379	1.073
Brown Brothers Harriman & Co	–	–	285.028	246	1.999.950	18.122.200
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto	–	6	–	–	–	–
Citibank, New York	–	8	–	–	10.175.191	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	–	–	–	–	225.273	–
HSBC Bank Plc, London	–	–	–	–	4	–
JPMorgan Chase, New York	–	8	–	–	–	–
National Australia Bank, London	–	8	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	8	–	–	–	107.557.301
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	8	–	31	–	–
Sumitomo, Tokyo	–	8	89.983.319	46.453.966	–	4
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>19.616</b>	<b>107.924.157</b>	<b>102.927.978</b>	<b>12.401.585</b>	<b>125.681.417</b>

\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Emerging Market Debt Blend		Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend		Emerging Markets Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	3.598	–	–	–	24	10.719.573
Bank of Nova Scotia, Toronto	262	–	1	2	15.773	–
BBH, Grand Cayman	1	2	–	–	–	328
BNP Paribas, Paris	421.660	1.161.361	–	–	231	1.613
Brown Brothers Harriman & Co	838.790	3.397.056	49.801	6.857	190.441	938.086
Credit Suisse AG, Zurich	25	26	–	–	–	2
HSBC Bank Plc, Hong Kong	168.430	–	–	–	355	–
JPMorgan Chase, New York	1.367.719	–	3.167.510	–	5.149.468	–
Nordea Bank, Oslo	–	–	7	8	–	12.550
Royal Bank of Canada, Toronto	–	36.387.264	–	2.737.683	–	686.674
Sumitomo, Tokyo	1.234.517	1.730.235	195.752	95.923	3	–
<b>Insgesamt</b>	<b>4.035.002</b>	<b>42.675.944</b>	<b>3.413.071</b>	<b>2.840.473</b>	<b>5.356.295</b>	<b>12.358.826</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Emerging Markets Select Equity		Euro Bond Absolute Return		Euro Opportunistic Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	EUR	EUR	US\$	US\$
Bank of Nova Scotia, Toronto	7	–	–	–	–	–
BBH, Grand Cayman	2	1	–	–	–	–
BNP Paribas, Paris	77	71	–	2.372.355	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	56.551	197.540	1.052	–	145	–
Citibank, London	–	–	–	–	473.003	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	484	474	–	–	–	–
JPMorgan Chase, New York	3.345.805	–	–	–	–	–
Nordea Bank, Oslo	–	–	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	1.742.349	15.670	–	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	–	15.857	–	–
Sumitomo, Tokyo	5	75.186	1.694.020	–	–	520.124
<b>Insgesamt</b>	<b>3.402.931</b>	<b>2.015.621</b>	<b>1.710.742</b>	<b>2.388.212</b>	<b>473.148</b>	<b>520.124</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	European High Yield Bond		European Sustainable Equity <sup>2</sup>		Event Driven <sup>1</sup>	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	EUR	EUR	EUR	EUR	US\$	US\$
ANZ Bank, London	–	–	24	–	1.047.071	–
BBH, Grand Cayman	–	–	10	–	–	–
BNP Paribas, Paris	–	634.304	–	–	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	3.356	–	451	–	21.102	–
Citibank, New York	–	136.033	–	–	2.901.931	–
Credit Suisse AG, Zurich	–	–	23	–	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	1	–	–	–	–	–
HSBC Bank Plc, London	–	180.425	–	–	1.928	–
JPMorgan Chase, New York	–	–	–	–	2.901.931	–
MUFG Bank, Tokyo	–	–	–	–	–	–
Nordea Bank, Oslo	–	–	22	246	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	419.586	–	37	–	–	–
Sumitomo, Tokyo	949.253	–	1.487.045	627.199	–	–
<b>Insgesamt</b>	<b>1.372.196</b>	<b>950.762</b>	<b>1.487.612</b>	<b>627.445</b>	<b>6.873.963</b>	<b>–</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global Bond		Global Diversified Income FMP – 2024		Global Equity Index PutWrite*	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	4.997	232.473	5.320.556	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	299.876	8.858.970	11.223.942	–	–	–
BBH, Grand Cayman	–	–	–	–	–	36.951
BNP Paribas, Paris	7.075	347	–	–	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	85.599	73	32.667	55	–	15
Citibank, New York	–	–	11.223.942	–	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	15.786	28.573	–	–	–	–
MUFG Bank, Tokyo	21.208	22.643	–	–	–	–
Nordea Bank, Oslo	52	58	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	2.702.169	–	11.223.942	13.562.090	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	685	738.281	–	–	–	–
Sumitomo, Tokyo	1.562.643	918.565	11.223.942	–	–	–
<b>Insgesamt</b>	<b>4.700.090</b>	<b>10.799.983</b>	<b>50.248.991</b>	<b>13.562.145</b>	<b>–</b>	<b>36.966</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global Equity Megatrends		Global Flexible Credit Income		Global High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	–	–	681.475	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	6	–	744	–	–	587.997
Brown Brothers Harriman & Co	660	5	45.556	366	20.691	–
HSBC Bank Plc, London	–	–	–	–	1.146	–
JPMorgan Chase, New York	–	–	8.843.449	–	4.833.186	–
National Australia Bank, London	–	–	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	77.062	–	–	49.252.852	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	4	–	–	3.071.486	–	2.969
Sumitomo, Tokyo	–	747.831	547.637	28.622.640	404.491	49.847
<b>Insgesamt</b>	<b>77.732</b>	<b>747.836</b>	<b>10.118.861</b>	<b>80.947.344</b>	<b>5.259.514</b>	<b>640.813</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global High Yield Sustainable Action		Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>		Global Opportunistic Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	915.917	–	–	–	1.160	31.451
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	–	331.728	–	1.451	67.634
BNP Paribas, Paris	–	–	–	–	31.700	367.592
Brown Brothers Harriman & Co	1.253	–	5.658	–	114.657	19.814
JPMorgan Chase, New York	–	578.427	–	–	5.157.636	–
National Australia Bank, London	–	–	–	–	–	–
MUFG Bank, Tokyo	–	–	–	–	–	6.836
Royal Bank of Canada, Toronto	–	–	1.647.409	446.046	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	13.904	–	–	419.632	291.327	890.396
Sumitomo, Tokyo	102.147	82.543	1.580.436	342.464	265.332	–
<b>Insgesamt</b>	<b>1.033.221</b>	<b>660.970</b>	<b>3.565.231</b>	<b>1.208.142</b>	<b>5.863.263</b>	<b>1.383.723</b>

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global Real Estate Securities		Global Sustainable Equity <sup>2</sup>		High Yield Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	9	719	–	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	916	4.023	–	–	–	–
Barclays Bank, London	–	2	–	–	10.543.050	–
BBH, Grand Cayman	–	–	5	–	–	–
BNP Paribas, Paris	–	–	–	–	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	3.184	–	4.994	7	388.523	847
Citibank, London	–	–	–	–	61.521	–
Citibank, New York	–	–	–	1.033.515	–	150.000.000
Credit Suisse AG, Zurich	–	–	6	–	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	16.142	10	–	–	–	–
JPMorgan Chase, New York	1.102.718	503.967	1.064.594	–	123.483.341	–
Nordea Bank, Oslo	–	–	945	1.050	–	–
MUFG Bank, Tokyo	–	–	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	–	–	–	–	16.539.681
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	60	–	–	–
Sumitomo, Tokyo	2.272	2.336	110	36	–	5.928.526
<b>Insgesamt</b>	<b>1.125.241</b>	<b>511.057</b>	<b>1.070.714</b>	<b>1.034.608</b>	<b>134.476.435</b>	<b>172.469.054</b>

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	InnovAsia 5G <sup>2</sup>		Japan Equity Engagement		Macro Opportunities FX	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	JPY	JPY	EUR	EUR
ANZ Bank, London	–	791.248	–	–	–	–
Barclays Bank, London	–	–	–	–	–	22
BBH, Grand Cayman	1	–	–	–	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	2.479	382.618	–	–	141	–
Citibank, New York	–	–	–	–	912	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	4	–	–	–	–	–
JPMorgan Chase, New York	–	–	–	–	–	6.456
MUFG Bank, Tokyo	–	–	421.921.338	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	593.850	–	–	–	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	–	–	20	–
Sumitomo, Tokyo	2	2	–	57.529.787	130.034	198.110
<b>Insgesamt</b>	<b>596.336</b>	<b>1.173.868</b>	<b>421.921.338</b>	<b>57.529.787</b>	<b>131.107</b>	<b>204.588</b>

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Multi-Asset Income		Multi-Style Premia*		Next Generation Mobility	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	27.772	196.899	–	249	9.687.021	2
Bank of Montreal, London	–	–	–	249	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	9	10	–	249	–	–
BBH, Grand Cayman	1	–	–	43.029	–	3
BNP Paribas, Paris	198	202	–	249	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	25.216	11	–	–	30.352	79
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto	–	–	–	249	–	–
Citibank, New York	–	833.489	–	249	–	–
Credit Suisse AG, Zurich	8	8	–	–	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	466	366	–	–	9	–
JPMorgan Chase, New York	663.587	387.263	–	249	–	–
MUFG Bank, Tokyo	46.385	40.693	–	–	–	–
National Australia Bank, London	–	–	–	249	–	–
Nordea Bank, Oslo	30	34	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	436.998	139.215	–	249	–	15.405.156
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	84.600	929.994	–	249	1	1.986.790
Sumitomo, Tokyo	510.051	123.488	–	249	–	3
<b>Insgesamt</b>	<b>1.795.321</b>	<b>2.651.672</b>	<b>–</b>	<b>45.768</b>	<b>9.717.383</b>	<b>17.392.033</b>

\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Next Generation Space Economy <sup>1</sup>		Short Duration Emerging Market Debt		Short Duration High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	–	–	191	–	–	30.441.319
BBH, Grand Cayman	1	–	–	1	–	–
BNP Paribas, Paris	–	–	–	–	399	409
Brown Brothers Harriman & Co	1.598	–	447.514	1.327	84.117	167
Citibank, New York	–	–	158.792.223	–	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	–	–	–	–	5	3
HSBC Bank Plc, London	–	–	–	213	–	–
JPMorgan Chase, New York	–	–	–	–	26.512.099	–
MUFG Bank, Tokyo	–	–	–	5	–	12
Royal Bank of Canada, Toronto	553.649	–	–	179.662.846	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	–	–	1.257.126	–
Sumitomo, Tokyo	26	–	37.315.688	39.699.011	12	787.015
<b>Insgesamt</b>	<b>555.274</b>	<b>–</b>	<b>196.555.616</b>	<b>219.363.403</b>	<b>27.853.758</b>	<b>31.228.925</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Strategic Income		Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>		Sustainable Emerging Market Corporate Debt	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	40	181	–	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	340.990	–	–	–	–	–
BBH, Grand Cayman	–	–	–	–	–	1
BNP Paribas, Paris	1.835.401	1.879.672	–	–	–	213.353
Brown Brothers Harriman & Co	514.071	112.270	7.098	15	172.843	166.221
Citibank, New York	92.478.753	–	–	–	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	25	5	–	–	–	–
JPMorgan Chase, New York	6.265.751	–	–	–	–	–
MUFG Bank, Tokyo	–	–	–	–	–	–
Nordea Bank, Oslo	5.386	5.989	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	101.131.901	2.228.125	595.613	6.780.260	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	–	–	–	682.163
Sumitomo, Tokyo	3.538.083	46.361.340	534.967	1.729.885	6	–
<b>Insgesamt</b>	<b>104.978.500</b>	<b>149.491.358</b>	<b>2.770.190</b>	<b>2.325.513</b>	<b>6.953.109</b>	<b>1.061.738</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency <sup>1</sup>		Systematic Global Sustainable Value		Ultra Short Term Euro Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR	EUR
ANZ Bank, London	–	–	1.176	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	–	1.980	545	–	–
BBH, Grand Cayman	–	–	120	–	–	–
BNP Paribas, Paris	–	–	40	61	–	28.729.750
Brown Brothers Harriman & Co	21.151	–	8.161	–	26.816	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	–	–	25	12	–	–
JPMorgan Chase, New York	–	–	–	–	93.584	51.271
MUFG Bank, Tokyo	–	–	3	6	–	–
Nordea Bank, Oslo	–	–	18	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	8.131.270	–	–	–	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	–	1.265	–	–
Sumitomo, Tokyo	472.775	–	715.983	19.204	9.919.073	80.629.256
<b>Insgesamt</b>	<b>8.625.196</b>	<b>–</b>	<b>727.506</b>	<b>21.093</b>	<b>10.039.473</b>	<b>109.410.277</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Uncorrelated Strategies		XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>		US Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	10.278.374	200.055.944	2.633.103	–	–	–
Bank of Montreal, London	–	191.820.081	–	–	–	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	4.692.746	185.962.966	716.044	–	–	–
Barclays Bank, London	1.461	42	–	–	–	–
BBH, Grand Cayman	1.671	262.793	120	–	–	–
BNP Paribas, Paris	1.551.615	501.126	3.110.791	–	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	6.239.065	8.193.070	171.782	–	7.205	3
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto	–	17.785.963	–	–	–	–
Citibank, London	7.014	–	1.636.196	–	–	–
Citibank, New York	29.580.967	7.375.982	4.245.695	–	–	–
Credit Suisse AG, Zurich	289.893	2.267.202	12.219	–	–	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	425.640	4.289.381	2.290	–	–	–
HSBC Bank Plc, London	511	91.327	155.949	–	–	–
JPMorgan Chase, New York	122.010.499	8.339.662	4.125.371	–	–	–
MUFG Bank, Tokyo	11.879	–	175.896	–	–	–
National Australia Bank, London	2.399.742	589.109	–	–	191.583	–
Nordea Bank, Oslo	1.487	1.204.952	11	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	59.244.394	215.350.773	31.631.227	–	–	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	8.513.551	10.737.084	2.585.640	–	–	–
Sumitomo, Tokyo	55.896.809	218.185.659	15.006.166	–	2.196.478	559.926
<b>Insgesamt</b>	<b>301.147.318</b>	<b>1.073.013.116</b>	<b>66.208.500</b>	<b>–</b>	<b>2.395.266</b>	<b>559.929</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	US Equity Index PutWrite		US Large Cap Value <sup>2</sup>		US Long Short Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Bank of Montreal, London	–	33.227.929	–	–	–	–
BBH, Grand Cayman	–	1	–	–	–	1
Brown Brothers Harriman & Co	157.884	291	140.298	–	98.659	219
Credit Suisse AG, Zurich	–	–	–	–	11	11
HSBC Bank Plc, Hong Kong	141	140	–	–	2	–
JPMorgan Chase, New York	–	–	–	–	15.573.911	–
National Australia Bank, London	–	16.468.396	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	–	–	75.057.821	59.203	3.197.677	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	–	–	–	13.377.582
Sumitomo, Tokyo	44.333.902	33.227.929	4	–	15.573.911	33.123.944
<b>Insgesamt</b>	<b>44.491.927</b>	<b>82.924.686</b>	<b>75.198.123</b>	<b>59.203</b>	<b>34.444.171</b>	<b>46.501.757</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	US Multi Cap Opportunities		US Real Estate Securities		US Small Cap	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
ANZ Bank, London	4	5	821	877	26.133	–
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	–	–	–	12.365	13.149
BBH, Grand Cayman	–	1	1	2	–	1
BNP Paribas, Paris	5	5	–	–	–	–
Brown Brothers Harriman & Co	5.734	21	59.573	–	48.019	47
Citibank, London	–	–	–	–	2	–
HSBC Bank Plc, Hong Kong	3	–	–	–	–	–
Royal Bank of Canada, Toronto	1.253.428	6.485.750	21.823.790	–	10.588.172	–
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	–	–	–	1	–	–
Sumitomo, Tokyo	–	8	5	–	–	12.237.836
<b>Insgesamt</b>	<b>1.259.174</b>	<b>6.485.790</b>	<b>21.884.190</b>	<b>880</b>	<b>10.674.691</b>	<b>12.251.033</b>

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	US Small Cap Intrinsic Value	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$
Bank of Nova Scotia, Toronto	–	3.474.080
Brown Brothers Harriman & Co	31.273	39
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	8.808.823	6.618.940
<b>Insgesamt</b>	<b>8.840.096</b>	<b>10.093.059</b>

Entsprechend den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies“ (Kassenbestände mit Zeichnungs-, Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern), die im März 2016 herausgegeben wurden, werden eines oder mehrere Konten für die Kassenbestände des Fonds in Übereinstimmung mit den Anforderungen der CBI von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Derlei Konten für Kassenbestände sind dazu gedacht, nicht abgewickelte Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknahmegelder und/oder sonstige an Anleger fällige Beträge zu halten. Zum 31. Dezember 2022 beliefen sich die Gelder in diesen Konten auf 1.424.081 US\$ (31. Dezember 2021: 29.999.148 US\$). Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**4. KONTENÜBERZIEHUNG**

Per 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 werden alle in der Bilanz ausgewiesenen Überziehungskredite bei Brown Brothers Harriman & Co. gehalten.

**5. ANTEILKAPITAL**

Das genehmigte Anteilkapital des Fonds beträgt 500.000.040.000 nennwertlose Anteile und besteht aus 40.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert sowie 500.000.000.000 gewinnberechtigten Anteilen ohne Nennwert. Die Direktoren sind befugt, bis zu 500.000.000.000 nennwertlose Anteile des Fonds zu den von ihnen für geeignet erachteten Konditionen auszugeben.

Der Fonds ist aufgrund seiner Fähigkeit, Anteile auf Aufforderung auszugeben und zurückzunehmen, eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Das Anteilkapital des Fonds ist in verschiedene Anteilsserien aufgeteilt, wobei jede Anteilsserie ein separates Investmentportfolio mit Vermögenswerten darstellt. Die Portfolios verwalten Kapital in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften und den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die für solch ein Portfolio gelten und im vorliegenden Prospekt und jeweiligen Nachtrag des Portfolios festgelegt sind. Die Portfolios unterliegen keinen extern vorgeschriebenen Kapitalerfordernissen. Während die Portfolios in übertragbare Wertpapiere und andere liquide Finanzanlagen investieren, verfolgt der Manager auch einen angemessenen Prozess zur Überwachung des Liquiditätsrisikos, der die von den Portfolios eingesetzten Transaktionen für ein effizientes Portfoliomanagement berücksichtigt, um sicherzustellen, dass jedes Portfolio in der Lage ist, die angegebenen Bedingungen bei Anteilsrücknahmen zu erfüllen.

Um potenzielle Liquiditätsrisiken zu mindern, passt der Manager seine Kontrollen an die verschiedenen Anlagestrategien, Liquiditätsbedingungen und das Kundenverhalten in der Vergangenheit an. Als Teil der Risikoüberwachung kann der Manager auf verschiedene Liquiditätstests zurückgreifen, deren Ergebnisse zahlreiche Lösungen bedingen können, darunter eine Anpassung der Zusammensetzung der Vermögenswerte, die Inanspruchnahme von Überziehungs- oder Kreditfazilitäten oder anderer geeignete Maßnahmen, um ein hinlängliches Liquiditätsniveau sicherzustellen. Alle Vereinbarungen auf Portfolioebene werden von der Risikofunktion des Managers, den Portfoliomanagern des betreffenden Portfolios, dem Chief Investment Officer des Managers sowie den Direktoren des Managers und den Direktoren der Gesellschaft überprüft. Das Risikoteam des Managers führt regelmäßig Portfoliostresstests im Kontext der Zusammensetzung des jeweiligen Portfolios und der aktuellen/potenziellen Marktbedingungen durch. Dabei werden Stressszenarien mit verschiedenen hypothetischen Rücknahmeniveaus durchgespielt und die Fähigkeit der Portfolios bewertet, Rücknahmeanträge auf diesen Niveaus auf ordnungsgemäße Weise zu erfüllen. Sollte die Analyse ergeben, dass eines der Portfolios eine niedrige Liquiditätsdeckungsquote aufweist, werden Rücksprachen seitens des Risikoteams des Managers und des Portfolioteams gehalten und relevante Schritte unternommen, um die damit verbundenen Risiken zu bewerten und auf bestmögliche Weise zu verringern. Ferner werden auf Tagesbasis die Liquiditätspuffer im Rahmen der Berichterstattung überwacht, um das Liquiditätsrisiko eines jeden Portfolios zu erfassen. Abgesehen davon werden die Marktliquidität betreffende Faktoren überwacht, um diesbezügliche potenzielle Anomalien zu erfassen.

Am 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 waren 2 Zeichneranteile ausgegeben. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf Hauptversammlungen des Fonds, berechtigen die Inhaber jedoch nicht am Gewinn oder am Vermögen des Fonds zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation. Die gewinnberechtigten Anteile ermächtigen die Inhaber zur Teilnahme und Stimmabgabe bei Hauptversammlungen des Fonds sowie zur Beteiligung an den Gewinnen und den Vermögenswerten des Fonds.

Die Zeichneranteile werden wie folgt gehalten:

<b>Name des Anteilinhabers</b>	<b>Anzahl der Anteile</b>
Matsack Nominees Limited	1
Neuberger Berman Europe Limited	1

Die Mindestzeichnungs- und Rücknahmegrenzen für jeden Teilfonds finden sich im Verkaufsprospekt des Fonds.

Das Kapital der Portfolios wird durch das auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteilen entfallende Nettovermögen repräsentiert. Der Betrag des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens kann sich auf Monatsbasis erheblich ändern, da die Portfolios monatlichen Zeichnungen und Rücknahmen nach Ermessen der Anteilinhaber unterliegen.

Die Ziele der Portfolios für die Verwaltung des Kapitals sind:

- das Kapital in Anlagen zu investieren, die den Anlagezielen, den Anlagepolitiken, dem Risiko und der erwarteten Rendite gemäß den Angaben im Verkaufsprospekt entsprechen;
- Erzielung von Renditen bei gleichzeitigem Kapitalschutz durch Anwendung der im Verkaufsprospekt angegebenen Anlagestrategien;
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Liquidität zur Begleichung der Ausgaben der Portfolios und um Rücknahmeanträge zu erfüllen, wenn sie entstehen; und
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Größe, um den Betrieb der Portfolios kosteneffizient zu gestalten.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Veränderung der Anzahl rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile im Geschäftsjahr:

## 5G Connectivity

	Thesaurierende Klasse AUD A	Thesaurierende Klasse CNY A*	Thesaurierende Klasse EUR A währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.604.463	52.732	7.433.954	6.167.163	5.429.505	7.941.448	311.788	4.539.162	1.492.479	82.730
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	71.103	–	764.409	3.177.781	2.057.988	2.180.308	–	862.513	39.345	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(538.420)	(11.142)	(3.023.215)	(3.553.698)	(2.402.269)	(5.286.293)	(117.660)	(502.321)	(309.541)	(14.208)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.137.146	41.590	5.175.148	5.791.246	5.085.224	4.835.463	194.128	4.899.354	1.222.283	68.522
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.688.722	–	3.902.538	3.206.906	1.792.944	1.267.748	50.000	2.304.875	766.672	2.326
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.755.062	52.732	5.568.271	4.980.060	8.207.064	8.923.918	367.758	3.166.534	915.683	92.191
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(839.321)	–	(2.036.855)	(2.019.803)	(4.570.503)	(2.250.218)	(105.970)	(932.247)	(189.876)	(11.787)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.604.463	52.732	7.433.954	6.167.163	5.429.505	7.941.448	311.788	4.539.162	1.492.479	82.730

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse HKD A	Thesaurierende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2*	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.536.035	2.909.801	61.777.605	24.758.164	3.120.952	995.963	10.641.211	2.514.302	3.526.969	87.653
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	234.576	79.507	2.756.481	2.837.113	178.355	–	792.941	100.134	247.437	26.079
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.356.238)	(708.693)	(18.305.530)	(12.877.746)	(1.367.590)	–	(1.698.685)	(1.368.365)	(850.527)	(1.537)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	5.414.373	2.280.615	46.228.556	14.717.531	1.931.717	995.963	9.735.467	1.246.071	2.923.879	112.195
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.527.721	2.054.430	43.123.118	15.013.230	1.453.764	–	4.088.818	2.140.705	7.766.027	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.820.789	2.196.589	39.014.667	18.264.856	1.977.359	995.963	7.872.219	405.345	5.202.220	122.060
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.812.475)	(1.341.218)	(20.360.180)	(8.519.922)	(310.171)	–	(1.319.826)	(31.748)	(9.441.278)	(34.407)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	8.536.035	2.909.801	61.777.605	24.758.164	3.120.952	995.963	10.641.211	2.514.302	3.526.969	87.653

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Absolute Return Multi Strategy\*\*

	Thesaurierende Klasse CHF I*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	186.211
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.300
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(190.511)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Absolute Return Multi Strategy\*\* (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR I2*	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse EUR Z*	Thesaurierende Klasse GBP Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	89.670	36.746	30.601	117.154	5.094	11.991
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	12.802	16.100	–	34.430	574	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(102.472)	(52.846)	(30.601)	(151.584)	(5.668)	(11.991)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Absolute Return Multi Strategy\*\* (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse JPY D*	Thesaurierende Klasse JPY I*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	92.128	4.816.260	305.158	186.207
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	11.784	264.567	22.575	181.497
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(103.912)	(5.080.827)	(327.733)	(367.704)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Absolute Return Multi Strategy\*\* (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	10.891
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(10.891)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Asian Debt - Hard Currency

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD M
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	35.619	171.476	40.715	41.226	955.959	–	–	67.231
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	249	776	–	–	1.162.791	1.000	1.000	7.891
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(748)	(53.042)	(21.259)	(11.175)	(947.710)	–	–	(19.734)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	35.120	119.210	19.456	30.051	1.171.040	1.000	1.000	55.388
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.143	101.529	214.109	146.383	10.342	961.959	–	–	163.698
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	10.724	16.721	126.667	13.343	33.856	–	–	–	32.947
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(17.867)	(82.631)	(169.300)	(119.011)	(2.972)	(6.000)	–	–	(129.414)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	35.619	171.476	40.715	41.226	955.959	–	–	67.231

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	1.000	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.000	1.193	848.201
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.000	2.193	848.201
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.000	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	1.000	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## China A-Share Equity

	Thesaurierende Klasse CNY (währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.461	44.290	250.091
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.934	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(43.290)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.461	2.934	250.091
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	688	96.238	98.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.001	7.315	152.091
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.228)	(59.263)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.461	44.290	250.091

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Bond

	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CNY I	Thesaurierende Klasse CNY Z	Thesaurierende Klasse EUR I* (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I2* (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.993	14.415	1.832	8.000	55.985	4.467	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.347	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(14.414)	–	(8.000)	(55.985)	(2.291)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.993	2.348	1.832	–	–	2.176	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	30.283	14.415	7.759	8.000	53.710	–	1.557.500
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	1.195.025	2.275	242.763	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(28.290)	–	(5.927)	(1.195.025)	–	(238.296)	(1.557.500)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.993	14.415	1.832	8.000	55.985	4.467	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## China Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	195.760	1.807.436	–	5.179.582	1.219.964
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	548.099	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(675.566)	(1.243.921)	–	(225.889)	(4.568)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	68.293	563.515	–	4.953.693	1.215.396
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	66.031	817.234	17.873	5.429.679	2.221
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	327.562	1.200.750	–	–	1.217.743
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(197.833)	(210.548)	(17.873)	(250.097)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	195.760	1.807.436	–	5.179.582	1.219.964

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Equity

	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I4*	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse EUR Z	Ausschüttende Klasse GBP A
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	29.100	91.322	59.292	–	–	891	16.265
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	5.565	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(22.048)	(11.074)	–	–	–	(15.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	29.100	69.274	53.783	–	–	891	1.265
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	29.100	93.153	68.860	4.750	12.396	891	37.065
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(1.831)	(9.568)	(4.750)	(12.396)	–	(20.800)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	29.100	91.322	59.292	–	–	891	16.265

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I2 Thesaurierende (nicht währungsgesichert)*	Klasse GBP I4*	Ausschüttende Klasse GBP I4*	Thesaurierende Klasse HKD A*	Thesaurierende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	9.629	–	–	–	82.932	1.511.178	80.016
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(9.629)	–	–	–	(10.692)	(387.426)	(30.208)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	72.240	1.123.752	49.808
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	9.629	17.079	2.399	92.171	99.385	2.183.045	100.507
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(17.079)	(2.399)	(92.171)	(16.453)	(671.867)	(20.491)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.629	–	–	–	82.932	1.511.178	80.016

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	10.238.115	981.572	–	2.273.337	1.745.160	16.176
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	173	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.617.518)	(98.902)	–	(2.271.981)	(280.414)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	8.620.770	882.670	–	1.356	1.464.746	16.176
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	13.046.617	1.156.456	15.244	2.273.337	2.182.981	16.176
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.095	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.810.597)	(174.884)	(15.244)	–	(437.821)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	10.238.115	981.572	–	2.273.337	1.745.160	16.176

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## CLO Income

	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I5*	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse SEK I	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	180.581	1.527.618	3.291.633	2.780	7.139	308.215	–	1.553.808
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.454	1.065.824	99.074	18.444	–	–	–	6.339	652.959
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(131.650)	(33.020)	(598.883)	(2.780)	(2.285)	(28.480)	–	(928.633)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.454	1.114.755	1.593.672	2.711.194	–	4.854	279.735	6.339	1.278.134
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	115.001	691.760	1.622.076	2.780	7.139	408.484	–	1.595.900
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	145.755	889.795	1.669.557	–	–	155.615	–	2.438.077
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(80.175)	(53.937)	–	–	–	(255.884)	–	(2.480.169)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	180.581	1.527.618	3.291.633	2.780	7.139	308.215	–	1.553.808

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I4*	Ausschüttende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.478.474	–	4.117.440	42.619
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	831.721	–	264.981	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.310.195	–	4.382.421	42.619
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.000.000	2.604.861	2.634.121	35.919
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.478.474	612.086	1.483.319	6.700
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(3.216.947)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.478.474	–	4.117.440	42.619

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Commodities<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I5*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M*	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	806	2.057.623	322.881	553.882	6.833.789	62.411	250.306
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(332.530)	(22.426)	(512.768)	(701.998)	(13.827)	(15.625)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	806	1.725.093	300.455	41.114	6.131.791	48.584	234.681

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I3
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	972.918	4.846.082	270.761	5.082.911	14.953.377	51.923.840	9.516.581	25.053.140	18.068.754	800.660
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	231.156	24.861	531.196	2.164.517	36.312.718	8.439.193	3.323.164	6.804.679	177.517
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(361.440)	(2.701.059)	(119.642)	(762.092)	(5.106.690)	(28.984.748)	(7.611.050)	(9.600.553)	(3.150.078)	(281.559)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	611.478	2.376.179	175.980	4.852.015	12.011.204	59.251.810	10.344.724	18.775.751	21.723.355	696.618
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.056.143	3.175.412	312.638	2.488.478	9.801.183	29.192.502	15.315.125	27.197.922	2.462	82.729
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	86.461	4.674.453	70.185	3.526.652	8.763.217	35.572.285	3.305.173	9.344.189	20.115.157	820.633
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(169.686)	(3.003.783)	(112.062)	(932.219)	(3.611.023)	(12.840.947)	(9.103.717)	(11.488.971)	(2.048.865)	(102.702)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	972.918	4.846.082	270.761	5.082.911	14.953.377	51.923.840	9.516.581	25.053.140	18.068.754	800.660

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P	Ausschüttende Klasse EUR P	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Thesaurierende Klasse GBP P
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.067.969	956.414	566.440	15.072.977	913.586	622.213	5.491.683	207.127	736.727
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.264.747	446.153	54.740	1.312.924	37.109	204.270	1.269.412	37.591	449.772
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(337.928)	(154.124)	(12.559.835)	(447.470)	(310.186)	(5.816.656)	(199.965)	(548.022)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	16.332.716	1.064.639	467.056	3.826.066	503.225	516.297	944.439	44.753	638.477
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.382.445	1.027.997	486.448	7.821.582	762.973	328.831	5.088.400	202.465	212.905
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.935.524	299.140	215.486	15.452.854	669.648	419.584	1.400.017	158.026	583.588
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(250.000)	(370.723)	(135.494)	(8.201.459)	(519.035)	(126.202)	(996.734)	(153.364)	(59.766)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	8.067.969	956.414	566.440	15.072.977	913.586	622.213	5.491.683	207.127	736.727



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP P	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I2
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	527.896	–	125.739	9.233.259	5.532.404	7.910	859.901	15.782.837	131.085	6.481.087
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	711.946	–	394	378.686	540.681	–	–	2.299.939	35.344	18.993
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(393.807)	–	(38.242)	(2.920.524)	(1.688.353)	–	(248.199)	(13.694.388)	–	(5.917.840)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	846.035	–	87.891	6.691.421	4.384.732	7.910	611.702	4.388.388	166.429	582.240
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	400.522	350.000	158.110	6.846.998	5.136.194	–	1.095.672	14.073.237	–	5.600.117
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	504.958	99.502	65.858	5.189.632	1.872.957	7.910	233.036	3.873.934	131.085	2.258.395
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(377.584)	(449.502)	(98.229)	(2.803.371)	(1.476.747)	–	(468.807)	(2.164.334)	–	(1.377.425)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	527.896	–	125.739	9.233.259	5.532.404	7.910	859.901	15.782.837	131.085	6.481.087

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	124.890	1.056.212	300.463	5.415.895	16.723
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	546.581	21.690	8.128	538.232	17.007
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(145.907)	(251.731)	(39.493)	(4.547.838)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	525.564	826.171	269.098	1.406.289	33.730
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	111.363	1.689.211	310.502	3.563.593	317.329
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	36.913	221.085	33.474	5.371.635	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(23.386)	(854.084)	(43.513)	(3.519.333)	(300.606)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	124.890	1.056.212	300.463	5.415.895	16.723

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Diversified Currency\*\*

	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.791	4.518	11.470	100.082
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.791)	(4.518)	(11.470)	(100.082)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD Iwährungsgesichert)	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse CHF I2	Thesaurierende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	336.608	3.044.734	–	5.175.988	3.624.178	1.268.188	2.537.540	26.528.625
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	10.636	279.725	4.300.000	22.773.581	601.730	97.218	2.441.751	3.451.354
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(36.947)	(551.320)	–	(7.055.663)	(1.443.588)	(176.996)	(1.561.171)	(18.480.731)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	310.297	2.773.139	4.300.000	20.893.906	2.782.320	1.188.410	3.418.120	11.499.248
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	457.241	2.560.308	–	2.608.766	2.889.400	1.291.514	2.568.629	24.635.688
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	39.771	4.532.754	–	3.046.584	3.011.841	293.982	3.395.882	17.745.658
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(160.404)	(4.048.328)	–	(479.362)	(2.277.063)	(317.308)	(3.426.971)	(15.852.721)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	336.608	3.044.734	–	5.175.988	3.624.178	1.268.188	2.537.540	26.528.625

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR 12	Ausschüttende Klasse EUR 12	Thesaurierende Klasse EUR 13	Thesaurierende Klasse EUR 13 (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse EUR 13*	Thesaurierende Klasse EUR 14
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	111.663	30.832.656	10.113.936	4.323.512	9.873.905	3.857.277	281.619	13.665.964
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.474.758	2.396.628	3.344.344	525.000	6.856.961	760.000	–	1.172.856
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(626.657)	(5.659.938)	(5.657.291)	(112.903)	(5.270.845)	(1.302.930)	(281.619)	(4.148.794)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.959.764	27.569.346	7.800.989	4.735.609	11.460.021	3.314.347	–	10.690.026
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	118.768	27.146.159	13.922.921	4.777.986	6.649.475	8.596.792	661.749	12.874.088
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.000	10.875.859	3.512.804	2.096.195	5.554.666	1.801.857	41.079	1.019.107
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(14.105)	(7.189.362)	(7.321.789)	(2.550.669)	(2.330.236)	(6.541.372)	(421.209)	(227.231)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	111.663	30.832.656	10.113.936	4.323.512	9.873.905	3.857.277	281.619	13.665.964

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P	Thesaurierende Klasse EUR Z	Thesaurierende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Thesaurierende Klasse GBP P
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	76.470	27.801	4.228.081	36.061	2.029.895	865.850	3.585.859	1.896.188	602.152
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	9.378.359	–	2	557.075	–	460.640	43.533	1.275.053	110.509	351.785
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.517.500)	(6.594)	(5.617)	(3.574.457)	–	(776.454)	(639.652)	(1.087.037)	(363.318)	(72.530)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.860.859	69.876	22.186	1.210.699	36.061	1.714.081	269.731	3.773.875	1.643.379	881.407
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	114.418	63.045	1.249.175	31.397	732.366	484.703	3.282.280	8.413.209	535.745
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	9.014	2	4.229.731	4.664	1.548.377	423.222	786.706	2.391.154	352.114
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(46.962)	(35.246)	(1.250.825)	–	(250.848)	(42.075)	(483.127)	(8.908.175)	(285.707)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	76.470	27.801	4.228.081	36.061	2.029.895	865.850	3.585.859	1.896.188	602.152

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse SEK Awährungsgesichert)	Thesaurierende Klasse SEK I (nicht Awährungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse SEK I2*	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	234.729	2.000.000	8.669.815	2.990	2.672.239	1.262.462	30.136.140	12.003.717	2.430	1.421.409
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	31.995	–	7.443.000	–	1.377.284	188.711	8.143.098	1.664.679	7.392	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(96.120)	–	(3.676.234)	(2.990)	(2.303.575)	(239.747)	(17.272.370)	(3.686.287)	(4.323)	(222.993)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	170.604	2.000.000	12.436.581	–	1.745.948	1.211.426	21.006.868	9.982.109	5.499	1.198.416
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	349.464	2.000.000	6.906.974	2.990	–	1.280.588	18.490.145	14.138.474	1.000	3.141.957
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.926	–	2.083.023	–	2.715.272	465.518	33.212.268	3.782.530	7.532	514.897
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(118.661)	–	(320.182)	–	(43.033)	(483.644)	(21.566.273)	(5.917.287)	(6.102)	(2.235.445)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	234.729	2.000.000	8.669.815	2.990	2.672.239	1.262.462	30.136.140	12.003.717	2.430	1.421.409

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I3	Ausschüttende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	57.055.486	15.142.161	14.157.129	2.892.812	10.470.561	–	2.202.670	491.168	2.774.160
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	22.235.525	733.266	1.009.450	591.308	594.440	–	332.572	32.117	432.042
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(30.867.000)	(5.395.361)	(11.937.539)	(1.728.533)	(362.830)	–	(641.980)	(36.574)	(1.239.705)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	48.424.011	10.480.066	3.229.040	1.755.587	10.702.171	–	1.893.262	486.711	1.966.497
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	63.961.500	13.078.273	27.895.816	6.451.868	12.302.794	500.000	3.322.277	806.957	4.542.840
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	39.895.599	3.073.817	5.800.877	2.966.683	300.008	–	418.352	100.859	2.513.901
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(46.801.613)	(1.009.929)	(19.539.564)	(6.525.739)	(2.132.241)	(500.000)	(1.537.959)	(416.648)	(4.282.581)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	57.055.486	15.142.161	14.157.129	2.892.812	10.470.561	–	2.202.670	491.168	2.774.160

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.500.000	820.791
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	9.569.574	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(811.038)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	12.069.574	9.753
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	248.347
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.500.000	671.101
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(98.657)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.500.000	820.791

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency

	Ausschüttende Klasse Thesaurierende AUD B (Monatlich)		Ausschüttende Klasse Thesaurierende AUD C2 (Monatlich)		Ausschüttende Klasse Thesaurierende AUD E (Monatlich)		Ausschüttende Klasse Thesaurierende AUD T (Monatlich)	
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.874.215	60.489	72.201	15.252	427.610	7.478	7.062.666	267.908
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	32.920	23.258	–	–	19.711	316	1.939.354	49.791
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.895.320)	(47.024)	(53.092)	(14.217)	(333.749)	(2.091)	(1.778.576)	(50.933)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.011.815	36.723	19.109	1.035	113.572	5.703	7.223.444	266.766
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.229.908	194.432	1.215.969	75.757	1.945.359	78.263	7.203.102	259.372
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	917.695	27.682	492.817	1.506	46.361	33.403	4.759.822	226.247
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.273.388)	(161.625)	(1.636.585)	(62.011)	(1.564.110)	(104.188)	(4.900.258)	(217.711)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.874.215	60.489	72.201	15.252	427.610	7.478	7.062.666	267.908

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.348.1 <sup>1</sup>	3.668.9	19.419.2 <sup>1</sup>	3.066.0 <sup>1</sup>	1.155.7 <sup>1</sup>	2.575.0
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	437.240	16.598	2.030.549	–	22.447	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.368.730)	(1.871.150)	(4.832.388)	(1.862.366)	(1.178.150)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	416.611	1.814.361	16.617.422	1.203.690	–	2.575.012
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.723.268	3.641.643	19.519.089	3.855.199	1.281.183	2.575.012
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.209.737	290.880	2.716.762	987.000	259.333	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.584.904)	(263.610)	(2.816.590)	(1.776.143)	(384.813)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.348.101	3.668.913	19.419.261	3.066.056	1.155.703	2.575.012

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	33.468	9.831.973	8.914	9.362.787	10.591.181
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	622	313.175	436	76.647	1.936.702
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(34.090)	(1.574.571)	–	(3.677.496)	(7.701.654)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	8.570.577	9.350	5.761.938	4.826.229
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	16.425	49.540	–	8.914	23.715.134	5.927.468
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	10.713	1.330	10.087.075	3.965	492.165	6.593.227
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(27.138)	(17.402)	(255.102)	(3.965)	(14.844.512)	(1.929.514)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	33.468	9.831.973	8.914	9.362.787	10.591.181

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C1*	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	12.369.887	111.944	48.992	1.068.304	2.052.642	7.146.348	270.658	–	363.914
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.795.578	7.096	4.798	11.784	426.493	1.236.935	23.550	–	38.562
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(8.620.313)	(16.348)	(13.348)	(495.970)	(758.433)	(5.395.984)	(224.534)	–	(270.727)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	5.545.152	102.692	40.442	584.118	1.720.702	2.987.299	69.674	–	131.749
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	125.355	107.450	630.821	2.524.358	14.708.485	471.470	14.977	1.107.046
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	17.856.766	63.925	56.329	492.096	692.982	2.626.395	69.677	–	486.605
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.486.879)	(77.336)	(114.787)	(54.613)	(1.164.698)	(10.188.532)	(270.489)	(14.977)	(1.229.737)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	12.369.887	111.944	48.992	1.068.304	2.052.642	7.146.348	270.658	–	363.914

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C2	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	10.263	1.579.392	83.939	7.668.272	49.154.691	1.949.580	9.446.506
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	140.879	2.985	192.560	3.700.133	73.206	1.151.195
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.399)	(892.564)	(47.731)	(2.571.175)	(8.160.185)	(1.945.372)	(3.894.390)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.864	827.707	39.193	5.289.657	44.694.639	77.414	6.703.311
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	60.211	3.765.583	262.922	–	67.834.064	2.343.376	11.922.369
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.636	546.266	83.342	8.354.015	3.969.630	66.558	5.144.969
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(54.584)	(2.732.457)	(262.325)	(685.743)	(22.649.003)	(460.354)	(7.620.832)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	10.263	1.579.392	83.939	7.668.272	49.154.691	1.949.580	9.446.506

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende			Ausschüttende				
	Thesaurierende Klasse USD I5*	Ausschüttende Klasse USD M*	Klasse USD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Y*	Klasse ZAR B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR B
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	10.232.675	364.727	16.751.294	20.191.331	7.756.959	167.621
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	4.245.889	223.077	803.818	2.769.806	777.350	3.576
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(3.248.681)	(115.626)	(437.637)	(3.757.115)	(5.152.972)	(109.784)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	11.229.883	472.178	17.117.475	19.204.022	3.381.337	61.413
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	29.603.222	2.000	10.813.773	374.488	15.731.633	–	13.020.590	386.078
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.145	20.864.188	313.651	1.080.550	20.192.307	3.280.236	31.563
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(29.603.222)	(3.145)	(21.445.286)	(323.412)	(60.889)	(976)	(8.543.867)	(250.020)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	10.232.675	364.727	16.751.294	20.191.331	7.756.959	167.621

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende		Ausschüttende		Ausschüttende	
	Klasse	Thesaurierende	Klasse	Thesaurierende	Klasse	Thesaurierende
	ZAR C2	Klasse	ZAR E	Klasse	ZAR T	Klasse
	(Monatlich)	ZAR C2	(Monatlich)	ZAR E	(Monatlich)	ZAR T
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	271.158	19.288	1.819.795	31.946	12.509.758	270.673
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.324	–	1.066.419	3.607	4.980.625	146.137
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(192.657)	(18.370)	(2.320.600)	(28.229)	(3.589.096)	(66.069)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	79.825	918	565.614	7.324	13.901.287	350.741
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.157.082	45.117	5.120.657	169.139	15.449.056	357.046
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	224.476	7.971	827.827	23.590	7.471.464	144.105
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.110.400)	(33.800)	(4.128.689)	(160.783)	(10.410.762)	(230.478)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	271.158	19.288	1.819.795	31.946	12.509.758	270.673



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

	Ausschüttende Klasse AUD I3	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I3
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	838.742	735.712	25.576.646	4.799.433	3.429.534	2.352.885	3.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	266.184	622.266	4.500.693	757.995	205.500	86.385	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(270.603)	(9.209.395)	(1.988.917)	(1.730.355)	(1.005.845)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.104.926	1.087.375	20.867.944	3.568.511	1.904.679	1.433.425	3.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.293.953	1.960.858	24.220.394	5.910.295	24.366.150	4.308.729	4.382.781
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	27.545	173.288	4.894.773	287.366	18.054.598	997.192	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(482.756)	(1.398.434)	(3.538.521)	(1.398.228)	(38.991.214)	(2.953.036)	(4.379.781)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	838.742	735.712	25.576.646	4.799.433	3.429.534	2.352.885	3.000

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z	Thesaurierende Klasse GBP I währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	50.811	2.300.297	64.193	68.909	9.487	47.813	7.969.618	2.129.774	67.660
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.255	143.294	4.701	5.848	–	6.070	9.497	485.624	5.957
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(480.237)	(15.599)	(34.874)	–	(20.996)	(7.978.576)	(1.160.981)	(6.773)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	59.066	1.963.354	53.295	39.883	9.487	32.887	539	1.454.417	66.844
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	76.313	2.243.008	91.694	100.435	12.136	66.772	12.046.786	1.781.836	74.752
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.700	190.041	2.544	1.262	904	18.797	931.591	921.881	2.165
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(29.202)	(132.752)	(30.045)	(32.788)	(3.553)	(37.756)	(5.008.759)	(573.943)	(9.257)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	50.811	2.300.297	64.193	68.909	9.487	47.813	7.969.618	2.129.774	67.660

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht Pwährungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse NOK U	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.702.498	120.606	16.888	2.285	255.617	331.074	53.122	1.077.163	138.851
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.598.832	32.606	–	–	240.910	583	1.535	121.202	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.578.136)	(55.542)	–	–	(231.477)	(3.741)	–	(216.837)	(10.123)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	723.194	97.670	16.888	2.285	265.050	327.916	54.657	981.528	128.728
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.599.245	107.871	20.939	79.501	637.160	58.480	43.784	1.050.442	250.013
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.827.866	20.305	782	2.427	95.465	391.448	18.945	2.006.791	2.910
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(724.613)	(7.570)	(4.833)	(79.643)	(477.008)	(118.854)	(9.607)	(1.980.070)	(114.072)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.702.498	120.606	16.888	2.285	255.617	331.074	53.122	1.077.163	138.851

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2*	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.302.920	183.411	857	6.511.508	4.576.696	117.705	73.585	10.645
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	582.689	–	–	334.979	–	–	16.799	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.078.109)	(129.149)	(857)	(1.316.367)	–	(28.718)	(8.490)	(1.186)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.807.500	54.262	–	5.530.120	4.576.696	88.987	81.894	9.459
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	14.351.191	109.400	857	5.821.632	4.018.808	422.900	215.068	11.595
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.584.804	81.027	–	3.501.461	557.888	2.748	38.116	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.633.075)	(7.016)	–	(2.811.585)	–	(307.943)	(179.599)	(950)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	8.302.920	183.411	857	6.511.508	4.576.696	117.705	73.585	10.645

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

	Thesaurierende Klasse AUD I2*	Thesaurierende Klasse NOK I	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.533.722	1.297.729	253.797	470.000	–	348.996
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.051.255	–	–	–	250.358
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(463.556)	(250.117)	–	–	(107.040)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.533.722	2.885.428	3.680	470.000	–	492.314
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	53.517	254215	–	2.452	374.485
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.533.722	1.319.751	3.680	470.000	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(75.539)	(4.098)	–	(2.452)	(25.489)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.533.722	1.297.729	253.797	470.000	–	348.996

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity

	Thesaurierende Klasse AUD B	Thesaurierende Klasse AUD C2	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD Twährungsgesichert)	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht CAD I2*)	Ausschüttende Klasse CAD I2*	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	77.425	6.917	11.885	187.792	10.285	1.492.500	381.451	46.687	22.279
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	17.986	409	3.069	34.641	–	–	61.061	2.364	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(52.690)	(6.073)	(1.218)	(42.771)	(2.000)	–	(284.109)	(5.547)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	42.721	1.253	13.736	179.662	8.285	1.492.500	158.403	43.504	22.279
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	134.660	2.613	40.999	300.586	6.227.056	–	276.998	72.910	17.803
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	210.574	10.546	51.025	151.375	1.526.312	1.492.500	474.312	1.862	4.476
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(267.809)	(6.242)	(80.139)	(264.169)	(7.743.083)	–	(369.859)	(28.085)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	77.425	6.917	11.885	187.792	10.285	1.492.500	381.451	46.687	22.279

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse JPY I*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C1*	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	38.853	17.841	1.174.407	476.703	328.832	–	33.145	19.471	15.399.570	6.185.010
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	11.671	–	–	117.946	103.942	–	4.188	28.447	2.982.466	25.478
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(11.463)	(11.000)	(1.174.407)	(83.681)	(290.524)	–	(25.315)	(21.226)	(3.827.594)	(6.172.926)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	39.061	6.841	–	510.968	142.250	–	12.018	26.692	14.554.442	37.562
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	38.775	17.841	2.994.997	459.047	453.405	29.206	35.893	228.826	16.227.318	6.119.553
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	78	447	5.572	88.548	856.647	2.510	169.075	113.242	5.040.524	1.853.182
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(447)	(1.826.162)	(70.892)	(981.220)	(31.716)	(171.823)	(322.597)	(5.868.272)	(1.787.725)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	38.853	17.841	1.174.407	476.703	328.832	–	33.145	19.471	15.399.570	6.185.010

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse ZAR B	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Thesaurierende Klasse ZAR E	Thesaurierende Klasse ZAR T
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	356.194	1.709.914	90.926	20.376	44.151	164.928
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.728.820	410.041	67.137	275	–	72.365
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.730.657)	(1.099.064)	(106.651)	(11.320)	(11.615)	(50.618)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	354.357	1.020.891	51.412	9.331	32.536	186.675
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	473.391	889.041	160.534	38.149	53.485	238.636
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	407.241	1.128.650	414.428	26.461	145.588	259.834
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(524.438)	(307.777)	(484.036)	(44.234)	(154.922)	(333.542)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	356.194	1.709.914	90.926	20.376	44.151	164.928



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Select Equity

	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	316.974	1.143.998	9.194.294	2.882	15.950
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	182.949	–	83.094	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(268.956)	(2.962)	(13.273)	(2.882)	(7.950)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	230.967	1.141.036	9.264.115	–	8.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	600.000	1.293.864	9.160.974	2.882	1.928.418
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	417.768	–	40.766	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(700.794)	(149.866)	(7.446)	–	(1.912.468)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	316.974	1.143.998	9.194.294	2.882	15.950

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Euro Bond Absolute Return

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR 15	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	387.980	1.377.486	2.016.235	1.314.758
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	38.756	930	639.539	1.393.454
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(211.704)	(1.377.486)	(887.188)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	215.032	930	1.768.586	2.708.212
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	133.675	1.377.486	1.649.378	1.314.758
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	432.826	–	911.815	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(178.521)	–	(544.958)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	387.980	1.377.486	2.016.235	1.314.758

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Euro Opportunistic Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.000	978.926
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.902	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.902	978.926
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.000	978.926
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.000	978.926

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## European High Yield Bond

	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse EUR X	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	59.014	–	37.016	–	479.831	3.481
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	12.718	–	10.250	–	4.413	6.750
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(754)	–	(864)	–	–	(10.231)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	70.978	–	46.402	–	484.244	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	15.684	30.166	1.015	32.864	35.817	397.411	89.327
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.154	39.659	–	8.076	–	82.420	14.839
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(22.838)	(10.811)	(1.015)	(3.924)	(35.817)	–	(100.685)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	59.014	–	37.016	–	479.831	3.481

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	160.081	–	1.043.739	–	631.554	861.306
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.332	–	299	–	–	1.300.133
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(125.649)	–	(1.027.907)	–	(409.030)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	39.764	–	16.131	–	222.524	2.161.439
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	67.410	8.266	376.401	15.000	1.415.868	673.821
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	140.888	8.882	668.306	–	–	427.344
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(48.217)	(17.148)	(968)	(15.000)	(784.314)	(239.859)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	160.081	–	1.043.739	–	631.554	861.306

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity<sup>2</sup>

	Ausschüttende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I*	Ausschüttende Klasse EUR I*	Ausschüttende Klasse EUR I3*	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse EUR Z*	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	2.992	3.544.179	4.652.561	200.000	2.396	26.561	1.000	1.971.793	1.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.627	1.315	1.027	14.308.101	12.633	–	3.543.082	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(1.117)	(3.544.179)	(2.739.674)	(160)	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.627	3.190	1.027	16.220.988	212.473	2.396	3.569.643	1.000	1.971.793	1.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	251.168	3.544.179	4.652.561	200.000	2.396	31.357	1.000	1.971.793	1.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(248.176)	–	–	–	–	(4.796)	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	2.992	3.544.179	4.652.561	200.000	2.396	26.561	1.000	1.971.793	1.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Event Driven<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse GBP I5*	Ausschüttende Klasse GBP I5*	Thesaurierende Klasse GBP P*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.369.000	2.584	2.584	1.001.000	242.352
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.369.000	2.584	2.584	1.001.000	242.352

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Bond

	Ausschüttende			Thesaurierende Klasse			Ausschüttende		Ausschüttende
	Klasse AUD T (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD C1	USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse*	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Klasse USD T (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD Z	Klasse ZAR T (Monatlich)*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.937	–	62.811	–	148.271	71.273	3.000	14.839.075	4.481
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	3.000	–	–	–	1.420.929	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(14.374)	–	–	(42.845)	–	(3.125.177)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.937	–	48.437	3.000	148.271	28.428	3.000	13.134.827	4.481
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	74.898	134.122	–	146.371	127.574	–	19.559.746	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.937	1.183	13.891	–	4.222	16.578	3.000	2.698.369	4.481
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(76.081)	(85.202)	–	(2.322)	(72.879)	–	(7.419.040)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.937	–	62.811	–	148.271	71.273	3.000	14.839.075	4.481

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse HKD A	Ausschüttende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	122.227	25.000	100.000	214.842	750.000	272.720	3.387.413	5.097.571	379.967	243.821
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	2.181	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	(10.000)	(437.213)	(520.328)	(126.400)	(19.704)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	122.227	25.000	100.000	214.842	750.000	262.720	2.950.200	4.579.424	253.567	224.117
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	272.377	25.000	100.000	276.818	750.000	272.720	3.963.904	6.314.888	578.891	593.821
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(150.150)	–	–	(61.976)	–	–	(576.491)	(1.217.317)	(198.924)	(350.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	122.227	25.000	100.000	214.842	750.000	272.720	3.387.413	5.097.571	379.967	243.821

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD X	Ausschüttende Klasse USD X
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.104.508	10.781.902
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(5.000.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.104.508	5.781.902
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.104.508	10.781.902
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.104.508	10.781.902

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Equity Index PutWrite\*\*

	Thesaurierende Klasse CHF 15*	Ausschüttende Klasse CHF 15*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	208.115	218.303
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(208.115)	(218.303)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Equity Index PutWrite\*\* (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR IS*	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse EUR Z*	Thesaurierende Klasse GBP I*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	17.416	483.032	40.366	124.291	33.442	6.946
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	10.134	3.305	797	23.166	179	158
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(27.550)	(486.337)	(41.163)	(147.457)	(33.621)	(7.104)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Equity Index PutWrite\*\* (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I5 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Ausschüttende Klasse USD I5*	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD X*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.975	30.172	93.074	509.831	13.000	1.600	100.268
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	10.853	–	–	11.744	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(18.828)	(30.172)	(93.074)	(521.575)	(13.000)	(1.600)	(100.268)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Equity Index PutWrite\*\* (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	587.393
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	69.975
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(657.368)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	183.655	2.297.293	304.508	1.309.925	1.605.824	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	242.316	999.209	–	387.698	287.778	1.347.320
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(33.070)	(578.851)	(2.255)	(949.981)	(410.630)	(334.621)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	392.901	2.717.651	302.253	747.642	1.482.972	1.012.699
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	41.803	1.182.697	347.889	145.775	514.812	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	167.424	1.721.142	86.692	1.198.072	1.271.493	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(25.572)	(606.546)	(130.073)	(33.922)	(180.481)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	183.655	2.297.293	304.508	1.309.925	1.605.824	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Flexible Credit Income

	Thesaurierende Klasse CAD I5*	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.500.000	299.356	–	38.595	33.076.878	982.153	11.653.437	38.979	571.721	930.894
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	107.508	–	9.471	6.974.366	245.888	192.595	–	128.463	14.178
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(30.622)	–	(5.864)	(21.345.166)	(290.643)	(110.105)	(3.993)	(119.400)	(459.982)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.500.000	376.242	–	42.202	18.706.078	937.398	11.735.927	34.986	580.784	485.090
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	338.124	2.075.187	5.028	36.548.984	1.000	3.000	7.763	1.000	931.301
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.500.000	188.429	–	34.816	3.748.871	987.177	11.686.847	31.216	616.846	2.876
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(227.197)	(2.075.187)	(1.249)	(7.220.977)	(6.024)	(36.410)	–	(46.125)	(3.283)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.500.000	299.356	–	38.595	33.076.878	982.153	11.653.437	38.979	571.721	930.894

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD I*	Thesaurierende Klasse CHF I4*	Ausschüttende Klasse CHF I4*	Thesaurierende Klasse CHF X*	Thesaurierende Klasse EUR I4*	Ausschüttende Klasse EUR I4*	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	1.967.593
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.223	5.993.488	339.523	2.931	6.256.908	141.559	2.846	239.186
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(2.334.817)	(113.142)	–	(2.645.560)	(45.312)	–	(162.712)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.223	3.658.671	226.381	2.931	3.611.348	96.247	2.846	2.044.067
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	2.027.899
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	254.089
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	(314.395)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	1.967.593

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I4*	Thesaurierende Klasse GBP X*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1*	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD M*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	68.756	–	9.572	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.449.844	2.398	995	–	816	27.180.169	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(616.464)	–	(16.533)	–	(3.396)	(4.873.173)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	833.380	2.398	53.218	–	6.992	22.306.996	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	962.677	42.812	442.359	–	5.500
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	1.663.056	–	320.670	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(2.556.977)	(42.812)	(753.457)	–	(5.500)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	68.756	–	9.572	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P*	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	230.509	–	1.000	656.664
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	83.387	–	1.013	789
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(156.799)	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	157.097	–	2.013	657.453
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	163.665	1.143	1.000	1.094.321
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	68.945	–	–	2.226
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.101)	(1.143)	–	(439.883)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	230.509	–	1.000	656.664

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Sustainable Action

	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Y*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.000	1.458.132	1.000	300.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.000	1.458.132	1.000	300.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.000	1.458.132	1.000	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	300.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.000	1.458.132	1.000	300.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.000	5.001.417	4.998.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	144.058	1.285	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	145.058	5.002.702	4.998.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.000	5.001.417	4.998.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.000	5.001.417	4.998.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Opportunistic Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1*	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	454.585	2.295	65.944	–	1.059.158	942.090	2.269.235
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	512.820	–	190	–	379.017	–	395.349
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(19.014)	–	(1.059.006)	–	(272.936)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	967.405	2.295	47.120	–	379.169	942.090	2.391.648
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	909.170	2.295	79.034	29.760	1.356.088	499.220	2.341.498
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	18.960	1.871	7.697	442.870	24.905
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(454.585)	–	(32.050)	(31.631)	(304.627)	–	(97.168)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	454.585	2.295	65.944	–	1.059.158	942.090	2.269.235

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M*	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	83.656	3.312.736
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.935	803.213
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(85.591)	(1.246.969)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	2.868.980
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	79.000	3.161.319
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	14.531	1.332.959
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(9.875)	(1.181.542)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	83.656	3.312.736

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Real Estate Securities

	Ausschüttende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR Mwährungsgesichert	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht Mwährungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD CI	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2*	Ausschüttende Klasse USD I5
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	809.283	100.679	8.510	7.007	492.609	17.770	1.204.954	–	320.057
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	421.681	14.038	700	300	129.425	4.042	880.811	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(57.260)	(11.216)	–	–	(184.851)	(7.173)	(762.631)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.173.704	103.501	9.210	7.307	437.183	14.639	1.323.134	–	320.057
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	20.843	7.810	6.807	229.317	11.000	211.864	50.537	3.315
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	841.074	87.756	1.084	1.147	420.261	11.514	1.108.670	–	316.742
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(31.791)	(7.920)	(384)	(947)	(156.969)	(4.744)	(115.580)	(50.537)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	809.283	100.679	8.510	7.007	492.609	17.770	1.204.954	–	320.057

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	160.948	357.656
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	18.490	178.571
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(104.667)	(259.114)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	74.771	277.113
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	5.848	9.811
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	157.408	347.845
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.308)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	160.948	357.656

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD M*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.434.035	5.048	126.953	722	723	–	3.877	1.951.221	2.830.918	1.378.094
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.670.939	1.122	2.689	55.858	487.376	128.325	70.294	667.682	1.131	36.447
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.276.035)	(89)	(5.027)	(3.072)	(83.268)	(128.325)	(2.238)	(1.416.283)	(2.830.918)	(1.372.213)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.828.939	6.081	124.615	53.508	404.831	–	71.933	1.202.620	1.131	42.328
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.951.139	5.048	127.286	722	723	–	3.877	1.951.221	3.761.339	1.378.094
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(517.104)	–	(333)	–	–	–	–	–	(930.421)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	8.434.035	5.048	126.953	722	723	–	3.877	1.951.221	2.830.918	1.378.094

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.323.346
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(854.795)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.468.551

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD A	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD B	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD E	Ausschüttende Klasse AUD I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.252.446	352.388	4.522.124	152.294	169.903	452.484	186.086	6.153.126
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	9.555	–	478.263	63.876	607	84.076	21.961	254.326
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(334.031)	(109.554)	(1.993.853)	(112.078)	(85.478)	(344.327)	(167.936)	(3.716.292)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.927.970	242.834	3.006.534	104.092	85.032	192.233	40.111	2.691.160
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.609.660	473.154	8.597.620	4.895	347.544	1.192.920	137.722	8.884.522
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	427.690	1.776	2.182.658	229.609	148.176	355.723	183.690	557.221
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(784.904)	(122.542)	(6.258.154)	(82.210)	(325.817)	(1.096.159)	(135.326)	(3.288.617)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.252.446	352.388	4.522.124	152.294	169.903	452.484	186.086	6.153.126

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	Thesaurierende Klasse AUD T	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	14.551.556	179.079	97.037	1.360.593	395.532	47.592
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.368.374	1.166	90.853	195.811	40.740	401.833
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.310.099)	(37.051)	(17.985)	(574.391)	(116.427)	(17.145)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.609.831	143.194	169.905	982.013	319.845	432.280
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	14.263.044	218.026	164.457	412.577	404.619	60.397
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.905.695	12.139	169.954	1.329.759	42.011	44.660
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.617.183)	(51.086)	(237.374)	(381.743)	(51.098)	(57.465)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	14.551.556	179.079	97.037	1.360.593	395.532	47.592

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse CHF I*	Thesaurierende Klasse CHF I2	Ausschüttende	Ausschüttende
			Klasse CNY A (Monatlich)	Klasse CNY A (Wöchentlich)*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	213.840	208.694	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	28.911	3.945	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(66.742)	(20.716)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	176.009	191.923	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	22.773	123.292	185.720	45.018
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.000	145.041	48.918	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(27.773)	(54.493)	(25.944)	(45.018)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	213.840	208.694	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CNY T (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	181.377	–	1.449.596	1.361.660	457.422	1.251.360
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	150.440	504.330	3.569	512.972
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(178.695)	–	(534.743)	(753.001)	(42.310)	(459.645)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.682	–	1.065.293	1.112.989	418.681	1.304.687
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	70.779	6.772	974.458	1.527.795	521.811	1.578.479
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	110.598	–	640.089	194.853	37.673	214.504
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(6.772)	(164.951)	(360.988)	(102.062)	(541.623)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	181.377	–	1.449.596	1.361.660	457.422	1.251.360

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.501.255	1.411.870	141.081	16.640.327	2.946	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.830	868.636	5.912.755	–	1.801	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(755.425)	(378.208)	(350.683)	(16.640.327)	(833)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	751.660	1.902.298	5.703.153	–	3.914	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.777.948	1.217.840	5.741.117	16.215.774	5.867	11.110
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	255.608	495.088	347.941	424.553	3.286	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(532.301)	(301.058)	(5.947.977)	–	(6.207)	(11.110)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.501.255	1.411.870	141.081	16.640.327	2.946	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende		Ausschüttende		Ausschüttende		Thesaurierende Klasse GBP I2
	Thesaurierende Klasse EUR Z	Klasse GBP A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse GBP A	Klasse GBP A	Thesaurierende Klasse GBP I	Klasse GBP I	
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	15.212	785.392	129.318	178.638	362.702	1.655.037	52.756
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.688	–	39	236	50.288	18.513
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(365.586)	(3.503)	(35.742)	(653)	(823.880)	(24.757)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	15.212	421.494	125.815	142.935	362.285	881.445	46.512
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	16.357	1.194.961	142.526	245.233	381.687	1.942.268	198.270
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.063	137.209	2.300	1.113	13.255	445.217	5.319
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.208)	(546.778)	(15.508)	(67.708)	(32.240)	(732.448)	(150.833)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	15.212	785.392	129.318	178.638	362.702	1.655.037	52.756

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I2	Thesaurierende Klasse GBP Z	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse HKD A*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.185.857	6.639	6.325.073	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	15.798.271	7.062	82.205	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.062.538)	(1.000)	(511.261)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	16.921.590	12.701	5.896.017	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	25.640.706	14.578	7.503.535	215.401
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.543.702	846	281.138	711
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(26.998.551)	(8.785)	(1.459.600)	(216.112)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.185.857	6.639	6.325.073	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SGD A
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	695.642	1.953.557	127.467
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	135.137	47.155	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(203.828)	(362.070)	(19.296)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	626.951	1.638.642	108.171
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	989.308	1.354.689	131.141
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	98.154	820.292	2.228
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(391.820)	(221.424)	(5.902)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	695.642	1.953.557	127.467

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C	Ausschüttende Klasse USD C*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	19.014.699	282.513	10.802.958	3.620.054	25.932.704	1.606.107	84.877	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.046.046	179.024	1.619.297	197.596	4.767.744	882.417	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.593.938)	(33.931)	(4.027.180)	(1.287.221)	(10.054.998)	(1.289.793)	(10.798)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.466.807	427.606	8.395.075	2.530.429	20.645.450	1.198.731	74.079	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	14.801.379	332.767	12.812.820	3.077.146	20.817.443	884.180	114.493	13.533
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	9.627.743	40.951	4.741.578	1.173.976	23.970.306	3.000.380	–	69
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.414.423)	(91.205)	(6.751.440)	(631.068)	(18.855.045)	(2.278.453)	(29.616)	(13.602)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	19.014.699	282.513	10.802.958	3.620.054	25.932.704	1.606.107	84.877	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD C2	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	319.543	89.428	1.226.172	278.674	2.836.482	315.621	11.152.610	17.515.806	4.464.055
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	303	122.568	261	1.072.069	218.024	4.726.773	4.362.177	211.675
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(55.827)	(15.864)	(678.897)	(63.437)	(1.752.840)	(258.781)	(7.969.141)	(4.890.719)	(2.584.843)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	263.716	73.867	669.843	215.498	2.155.711	274.864	7.910.242	16.987.264	2.090.887
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	627.507	91.817	1.272.352	135.788	3.414.339	256.981	3.381.252	21.963.828	4.004.479
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	22.508	53.049	1.201.056	347.526	1.866.764	381.936	17.868.784	5.938.015	1.475.529
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(330.472)	(55.438)	(1.247.236)	(204.640)	(2.444.621)	(323.296)	(10.097.426)	(10.386.037)	(1.015.953)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	319.543	89.428	1.226.172	278.674	2.836.482	315.621	11.152.610	17.515.806	4.464.055

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse Thesaurierende USD I2 (Monatlich)		Ausschüttende Klasse Thesaurierende USD I2 (Monatlich)		Ausschüttende Klasse Thesaurierende USD I4 (Monatlich)			Ausschüttende Klasse Thesaurierende USD T (Monatlich)		Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)
	USD I2 (Monatlich)	Klasse USD I2	Klasse USD I2	Klasse USD I2	USD I4 (Monatlich)	Klasse USD M	Klasse USD M	Klasse USD P	(Monatlich)	(Wöchentlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.343.830	27.499.697	10.777.295	18.079.681	49.242	41.770	664.802	25.143.726	335.777	
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	301.822	2.475.433	12.865.165	–	8.734	133	118.320	4.115.134	9.152	
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.025.306)	(10.374.233)	(3.886.213)	(4.104.537)	(12.331)	(20.790)	(370.772)	(5.901.342)	(38.283)	
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.620.346	19.600.897	19.756.247	13.975.144	45.645	21.113	412.350	23.357.518	306.646	
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	5.974.016	29.588.038	21.156.445	16.187.533	67.319	80.822	500.355	23.272.756	400.249	
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.402.340	9.445.699	6.570.448	1.892.148	15.661	27.909	418.127	12.443.776	13.507	
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(32.526)	(11.534.040)	(16.949.598)	–	(33.738)	(66.961)	(253.680)	(10.572.806)	(77.979)	
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.343.830	27.499.697	10.777.295	18.079.681	49.242	41.770	664.802	25.143.726	335.777	

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD T	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	717.447	109.686	1.023.568	5.546.591	–	10.350.000	305.726	2.340.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	348.411	–	–	1.050.065	–	2.613.298	17.028	1.184.623
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(434.502)	–	(163.559)	(1.470.566)	–	(6.118.019)	(188.703)	(2.175.491)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	631.356	109.686	860.009	5.126.090	–	6.845.279	134.051	1.349.132
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	504.445	109.686	909.681	4.500.856	123.216	11.722.532	805.623	3.587.775
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.542.820	–	408.968	2.913.786	12.640	9.447.003	218.822	1.970.725
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.329.818)	–	(295.081)	(1.868.051)	(135.856)	(10.819.535)	(718.719)	(3.218.500)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	717.447	109.686	1.023.568	5.546.591	–	10.350.000	305.726	2.340.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR T
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	114.268	30.713.417	157.249
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	61.094	3.450.302	67.013
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(108.746)	(5.959.870)	(111.654)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	66.616	28.203.849	112.608
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	133.628	32.903.960	222.276
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	203.442	7.401.713	405.617
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(222.802)	(9.592.256)	(470.644)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	114.268	30.713.417	157.249



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse CHF I4*	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I4*	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse SGD A*	Thesaurierende Klasse SGD I4*	Thesaurierende Klasse SGD X*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	95.687	12.539	94.116	2.584	494.714	2.031	52.295	26.311	25.197	476.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	14.814	42.150	41.213	1.269	500	–	1.800	2.649	13.112	405.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(36.944)	(10.000)	(9.190)	–	(320)	–	(1.332)	(2.592)	(19.150)	(405.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	73.557	44.689	126.139	3.853	494.894	2.031	52.763	26.368	19.159	476.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	106.702	12.539	95.366	2.584	494.714	2.031	54.354	26.311	25.197	476.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(11.015)	–	(1.250)	–	–	–	(2.059)	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	95.687	12.539	94.116	2.584	494.714	2.031	52.295	26.311	25.197	476.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD M*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	758.228	285.914	1.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	120.679	68.759	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(300.601)	(86.438)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	578.306	268.235	1.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	815.739	286.414	1.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(57.511)	(500)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	758.228	285.914	1.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement

	Ausschüttende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse GBP I5*währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse JPY I5*	Thesaurierende Klasse JPY Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	29.970	2.242	327.759	3.488.199	503.328	133.863
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.558.565	9.534	–	25.611	3.186	316.224	4.706.172
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(201.875)	–	–	(6.209)	(2.983.942)	(145.805)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.356.690	39.504	2.242	347.161	507.443	673.747	4.840.035
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	3.000	497.000	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	29.970	2.242	325.653	3.760.612	555.578	133.863
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	(894)	(769.413)	(52.250)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	29.970	2.242	327.759	3.488.199	503.328	133.863

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Macro Opportunities FX

	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse SEK I	Ausschüttende Klasse SEK I	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	553.740	2.749	16.762	2.350.496	217.428	1.081	1.294.647	473.699
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	41.991	–	–	1.998.140	13.272	–	–	256.410
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(480.184)	(2.749)	–	(1.535.250)	(229.954)	–	(1.294.647)	(19.567)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	115.547	–	16.762	2.813.386	746	1.081	–	710.542
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	41.959	2.749	35.996	54.836	2.830	3.000	2.127.422	947.536
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	524.165	–	1.009	3.086.388	225.500	–	57.579	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(12.384)	–	(20.243)	(790.728)	(10.902)	(1.919)	(890.354)	(473.837)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	553.740	2.749	16.762	2.350.496	217.428	1.081	1.294.647	473.699

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income

	Ausschüttende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR M*	Ausschüttende Klasse EUR M*	Ausschüttende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	57.768	–	–	2.332	652.502	292.728	108.506	21.895
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	29.413	–	–	–	59.774	–	247	4.310
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(87.181)	–	–	–	(59.383)	(57.171)	(49.636)	(13.853)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	2.332	652.893	235.557	59.117	12.352
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.675	43.270	24.086	4.148	2.332	451.491	363.014	471.450	17.386
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.225	34.210	1.383	6.597	–	222.427	4.028	299.224	7.649
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.900)	(19.712)	(25.469)	(10.745)	–	(21.416)	(74.314)	(662.168)	(3.140)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	57.768	–	–	2.332	652.502	292.728	108.506	21.895

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Multi-Asset Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2*	Thesaurierende Klasse USD M
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	678.552	210.688
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	27.208	9.186
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(705.760)	(72.722)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	147.152
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	218.702
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	678.552	40.960
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(48.974)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	678.552	210.688

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Multi-Style Premia\*\*

	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.000	1.096.097	119.856
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.000)	(1.096.097)	(119.856)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Next Generation Mobility

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I* währungsgesichert	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	13.186	409.524	2.575.102	1.815.622
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	900	28.874	1.077.534	331.074
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.723)	(405.564)	(904.435)	(228.894)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	11.363	32.834	2.748.201	1.917.802
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	10.334	–	613.103	970.284
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.823	428.024	2.376.740	1.175.372
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.971)	(18.500)	(414.741)	(330.034)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.186	409.524	2.575.102	1.815.622

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD X
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.901.560	219.776	930.498	531.011	588.779	2.209.933
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	574.460	–	111.239	28.095	97.045	211.124
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(421.847)	(82.187)	(671.413)	(137.500)	(191.086)	(510.079)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.054.173	137.589	370.324	421.606	494.738	1.910.978
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	942.979	161.004	574.429	1.325.783	77.297	223.363
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.269.084	128.722	478.015	230.573	681.926	3.291.395
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(310.503)	(69.950)	(121.946)	(1.025.345)	(170.444)	(1.304.825)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.901.560	219.776	930.498	531.011	588.779	2.209.933

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD I*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	446.026	113.032	300.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.839)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	443.187	113.032	300.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF A	Ausschüttende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I	Ausschüttende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I2	Ausschüttende Klasse CHF I2	Thesaurierende Klasse CHF I5
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	328.543	532.977	657.644	118.730	1.506.083	111.470	329.049	1.685.488	406.638
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.439	–	22.399	13.530	207.031	96.000	1.970.828	2.700	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2)	–	(194.468)	(10.966)	(402.388)	(38.990)	(303.354)	(32.800)	(255.438)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	329.980	532.977	485.575	121.294	1.310.726	168.480	1.996.523	1.655.388	151.200
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	188.732	49.064	705.177	141.758	1.327.656	1.337.994	451.876	1.629.497	395.700
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	142.926	500.000	107.451	42.273	508.170	209.576	2.400	55.991	22.500
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.115)	(16.087)	(154.984)	(65.301)	(329.743)	(1.436.100)	(125.227)	–	(11.562)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	328.543	532.977	657.644	118.730	1.506.083	111.470	329.049	1.685.488	406.638

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse CHF P*	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.062.953	–	15.750.484	2.640.162	104.437.045	–	20.753.466	10.539.102
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.997.643	–	1.476.933	399.868	29.397.259	–	9.213.995	19.141.989
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.063.993)	–	(4.914.299)	(684.804)	(62.479.675)	–	(6.749.045)	(8.337.222)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.996.603	–	12.313.118	2.355.226	71.354.629	–	23.218.416	21.343.869
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.840.379	1.245	17.777.579	2.544.438	80.116.173	2.568	23.846.019	10.730.035
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	941.123	9.210	7.040.588	1.336.488	67.608.343	19.646	11.282.000	3.987.169
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(718.549)	(10.455)	(9.067.683)	(1.240.764)	(43.287.471)	(22.214)	(14.374.553)	(4.178.102)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.062.953	–	15.750.484	2.640.162	104.437.045	–	20.753.466	10.539.102

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P	Thesaurierende Klasse EUR U	Ausschüttende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse GBP A	Thesaurierende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.614.888	585.631	318.221	181.972	13.153.015	548.931	5.600.000	182.824	404.719	558.512
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.360.047	593.013	50.716	7.429	2.733.710	8.047	–	71.695	108.375	91.511
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(173.894)	(578.945)	(79.499)	(24.385)	(4.545.961)	(147.054)	–	(76.129)	(57.081)	(198.913)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.801.041	599.699	289.438	165.016	11.340.764	409.924	5.600.000	178.390	456.013	451.110
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	14.664.642	656.057	395.592	182.546	10.354.126	200.094	5.600.000	269.953	558.144	580.710
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	269.689	20.588	107.936	34.459	7.078.116	349.787	–	55.942	209.679	193.841
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(13.319.443)	(91.014)	(185.307)	(35.033)	(4.279.227)	(950)	–	(143.071)	(363.104)	(216.039)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.614.888	585.631	318.221	181.972	13.153.015	548.931	5.600.000	182.824	404.719	558.512

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse GBP P	Ausschüttende Klasse GBP P*	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	466.043	58.937.663	13.010.262	59.955	28.500	90.791.421	11.045.650	248.014	2.138.768	3.108.113
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	96.235	9.805.715	5.859.201	153.152	15.480	5.483.477	122.818	45.202	994.763	742.141
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(367.134)	(6.836.887)	(1.840.672)	(41.782)	(43.980)	(7.919.425)	(5.785.107)	(126.246)	(555.712)	(1.014.310)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	195.144	61.906.491	17.028.791	171.325	–	88.355.473	5.383.361	166.970	2.577.819	2.835.944
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	380.093	48.091.246	11.899.425	25.615	–	88.219.967	8.599.315	185.354	1.583.248	983.727
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	174.252	38.230.638	2.545.060	55.809	67.000	7.453.810	2.446.335	128.349	883.679	2.928.890
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(88.302)	(27.384.221)	(1.434.223)	(21.469)	(38.500)	(4.882.356)	–	(65.689)	(328.159)	(804.504)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	466.043	58.937.663	13.010.262	59.955	28.500	90.791.421	11.045.650	248.014	2.138.768	3.108.113

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I5	Ausschüttende Klasse USD I5
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	51.068.297	21.313.162	5.292.052	582.573	90.250.991	22.169.862	10.053.832	12.404.415	541.892	1.700.784
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.429.875	3.699.288	–	1.348	8.834.909	1.607.356	10.196.253	1.738.668	17.599	964.069
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(18.938.137)	(10.288.211)	(1.392.282)	(125.516)	(36.216.245)	(14.323.619)	(6.453.291)	(3.872.080)	(97.216)	(99.033)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	36.560.035	14.724.239	3.899.770	458.405	62.869.655	9.453.599	13.796.794	10.271.003	462.275	2.565.820
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	46.935.490	17.379.094	6.458.312	677.795	55.277.621	17.823.090	7.077.103	8.080.548	560.265	646.751
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	23.426.621	8.432.716	1.916.654	77.626	60.866.717	8.231.060	4.194.150	8.404.613	93.870	1.072.500
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(19.293.814)	(4.498.648)	(3.082.914)	(172.848)	(25.893.347)	(3.884.288)	(1.217.421)	(4.080.746)	(112.243)	(18.467)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	51.068.297	21.313.162	5.292.052	582.573	90.250.991	22.169.862	10.053.832	12.404.415	541.892	1.700.784

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.959.069	1.049.439	16.647.169	2.069.373
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	522.220	348.065	3.334.781	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.240.386)	(175.088)	(3.425.396)	(915.438)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.240.903	1.222.416	16.556.554	1.153.935
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	5.236.038	1.055.411	8.234.732	1.392.066
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.159.928	352.534	10.845.642	966.409
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.436.897)	(358.506)	(2.433.205)	(289.102)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.959.069	1.049.439	16.647.169	2.069.373



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	60.909	79.530	19.499
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	113.584	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.110)	(6.000)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	168.383	73.530	19.499
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	51.584	103.590	72.511
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	9.325	3.550	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(27.610)	(53.012)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	60.909	79.530	19.499

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende		Thesaurierende	
	Klasse CNY A (Monatlich)	Klasse EUR A	Klasse EUR A	Klasse EUR I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	22.899	1.296.606	390.699	4.424.657
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.267	279.134	12.100	1.189.077
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(850)	(532.554)	(30.724)	(2.300.441)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	24.316	1.043.186	372.075	3.313.293
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	21.389	1.301.856	645.041	1.777.356
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.510	604.280	–	4.126.651
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(609.530)	(254.342)	(1.479.350)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	22.899	1.296.606	390.699	4.424.657

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2*	Ausschüttende Klasse EUR I3*	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	88.001	–	–	157.391	85.831	1.259.686	1.128.213	106.086
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	444.840	–	–	4.437	16.061	–	157.817	5
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(13.900)	–	–	(69.654)	(9.599)	(75.090)	(966.947)	(6.596)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	518.941	–	–	92.174	92.293	1.184.596	319.083	99.495
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	221.668	73.285	25.387.970	93.039	119.817	890.550	498.470	106.081
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	280	–	89.994	5.172	424.243	643.317	5
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(133.667)	(73.565)	(25.387.970)	(25.642)	(39.158)	(55.107)	(13.574)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	88.001	–	–	157.391	85.831	1.259.686	1.128.213	106.086

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende			Ausschüttende			
	Ausschüttende Klasse GBP I2	Klasse HKD A (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I*	Klasse SGD A (Monatlich)	Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	486.236	–	14.079.861	–	80.298	533.328	2.899.367
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.833	279.363	1.728.546	1.500.000	166.027	31.026	1.718.379
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(306.394)	(41.818)	(1.223.638)	–	(99.629)	(154.776)	(1.931.512)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	188.675	237.545	14.584.769	1.500.000	146.696	409.578	2.686.234
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	680.131	–	17.337.409	–	19.120	252.690	2.527.287
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	34.923	–	657.984	–	70.769	331.036	898.551
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(228.818)	–	(3.915.532)	–	(9.591)	(50.398)	(526.471)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	486.236	–	14.079.861	–	80.298	533.328	2.899.367

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C*	Ausschüttende Klasse USD C*	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.111.564	–	–	434.343	7.172.968
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	145.212	–	–	–	5.316.388
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(53.387)	–	–	(49.072)	(3.942.530)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.203.389	–	–	385.271	8.546.826
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.136.990	10.231	16.832	698.446	14.987.028
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	153.401	–	83	10.595	3.727.923
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(178.827)	(10.231)	(16.915)	(274.698)	(11.541.983)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.111.564	–	–	434.343	7.172.968

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.141.951	8.374.379	273.202	–	279.280	116.292	857.639
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	83.377	–	42.153	2.514.199	599.751	341.786	135.961
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.908.226)	(1.203.088)	(77.979)	–	(82.375)	(12.664)	(217.144)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	317.102	7.171.291	237.376	2.514.199	796.656	445.414	776.456
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.896.159	518.520	234.513	–	314.522	128.952	1.014.267
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	636.138	7.952.547	74.915	–	99.226	20.208	23.471
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.390.346)	(96.688)	(36.226)	–	(134.468)	(32.868)	(180.099)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.141.951	8.374.379	273.202	–	279.280	116.292	857.639

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M*	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	589.284	2.408.654	1.123.616	–	–	567.731	221.329	–	335.052
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.243	6.405.843	37.229	5.400	–	227.899	5.611	–	2.950
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(121.248)	(300.265)	(289.924)	–	–	(140.034)	(91.707)	–	(112.793)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	471.279	8.514.232	870.921	5.400	–	655.596	135.233	–	225.209
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	749.517	755.566	1.035.792	–	40.334	397.100	206.840	28.045	279.438
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	172.829	1.824.011	407.103	–	22.171	265.994	27.123	5.527	212.533
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(333.062)	(170.923)	(319.279)	–	(62.505)	(95.363)	(12.634)	(33.572)	(156.919)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	589.284	2.408.654	1.123.616	–	–	567.731	221.329	–	335.052

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende		Thesaurierende		Ausschüttende		Ausschüttende		Ausschüttende	
	Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse JPY	Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse JPY I CG	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse JPY Z*	Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SGD A	Klasse SGD I (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.042.998	12.356.093	2.351.292	6.692.084	9.131.838	–	1.732.128	337.853	372.945	6.948.278
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.096.532	6.848.895	–	552.581	–	13.900.889	114.346	112.338	427.307	1.107.963
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.768.657)	(7.443.489)	(2.832)	(502.210)	–	(2.921.142)	(428.007)	(233.293)	(152.180)	(3.146.717)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.370.873	11.761.499	2.348.460	6.742.455	9.131.838	10.979.747	1.418.467	216.898	648.072	4.909.524
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	733.302	9.864.415	2.354.300	6.692.084	9.131.838	–	1.529.066	143.432	223.980	4.784.991
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.507.337	3.855.016	–	–	–	–	558.166	341.839	164.506	4.157.148
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(197.641)	(1.363.338)	(3.008)	–	–	–	(355.104)	(147.418)	(15.541)	(1.993.861)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.042.998	12.356.093	2.351.292	6.692.084	9.131.838	–	1.732.128	337.853	372.945	6.948.278

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	25.485.732	1.656.220	6.626.975	30.078.171	2.459.752	6.343.104	987.823	3.748.472
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.267.596	204.194	–	8.255.717	690.416	1.507.999	142.142	67.969
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.003.079)	(235.998)	(2.227.018)	(8.171.060)	(456.442)	(1.662.826)	(135.903)	(357.384)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	26.750.249	1.624.416	4.399.957	30.162.828	2.693.726	6.188.277	994.062	3.459.057
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	21.786.170	968.745	6.195.189	24.698.839	1.777.573	4.914.348	686.271	4.218.916
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.863.764	1.248.916	2.004.861	10.404.254	1.055.195	2.675.209	393.847	208.903
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.164.202)	(561.441)	(1.573.075)	(5.024.922)	(373.016)	(1.246.453)	(92.295)	(679.347)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	25.485.732	1.656.220	6.626.975	30.078.171	2.459.752	6.343.104	987.823	3.748.472

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse GBP X*	Ausschüttende Klasse GBP X*	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z*	Ausschüttende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	1.000	1.000	2.498.000	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.048.830	22.390	1.022.396	–	–	1.225	5.819	3.212.677	721.340
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.619.053)	–	(1.022.396)	–	–	(2.498.000)	(5.819)	(804.020)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	429.777	22.390	–	1.000	1.000	1.225	–	2.408.657	721.340
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	1.000	1.000	2.498.000	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	1.000	1.000	2.498.000	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

	Thesaurierende Klasse CHF A*	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I2*	Thesaurierende Klasse CHF I4	Thesaurierende Klasse CHF I5*	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR I3
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	2.121.106	–	943.136	–	213.963	47.988	–	32.268
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	272.329	–	–	–	80.000	–	–	2.912
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(1.359.015)	–	(486.525)	–	(230.467)	(2.005)	–	(10.908)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	1.034.420	–	456.611	–	63.496	45.983	–	24.272
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	20.196	2.043.670	50.000	1.300.000	73.043	388.520	49.298	40.530	74.202
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	112.436	–	–	–	344.162	–	–	7.659
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(20.196)	(35.000)	(50.000)	(356.864)	(73.043)	(518.719)	(1.310)	(40.530)	(49.593)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	2.121.106	–	943.136	–	213.963	47.988	–	32.268

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse SEK A
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	61.544	63.965	4.068.252	9.545	52.436
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	727	4.837	–	–	8.746
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(6.177)	(11.249)	–	(7.387)	(27.977)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	56.094	57.553	4.068.252	2.158	33.205
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.270	73.386	99.102	4.068.252	10.888	67.849
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.400	971	–	814	40.424
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.270)	(14.242)	(36.108)	–	(2.157)	(55.837)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	61.544	63.965	4.068.252	9.545	52.436

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende								
	Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	457.011	568.237	106.599	1.548.109	308.361	75.000	37.058	97.693	95.176
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.945	68.018	–	1.069.743	3.408	5.000	3.400	–	14.252
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(379.403)	(117.892)	(37.044)	(1.023.778)	(10.740)	(15.000)	(13.000)	(17.400)	(17.970)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	85.553	518.363	69.555	1.594.074	301.029	65.000	27.458	80.293	91.458
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	463.164	612.637	466.691	1.330.366	308.581	94.547	61.993	219.825	81.724
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	78.294	238.414	2.899	1.129.771	3.050	19.000	27.057	42.683	20.025
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(84.447)	(282.814)	(362.991)	(912.028)	(3.270)	(38.547)	(51.992)	(164.815)	(6.573)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	457.011	568.237	106.599	1.548.109	308.361	75.000	37.058	97.693	95.176

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR I3*	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.183.738	1.368.322	8.140.270	1.000	7.267.654
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(26.916)	(1.118.400)	(434.128)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.156.822	249.922	7.706.142	1.000	7.267.654

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Systematic Global Sustainable Value

	Thesaurierende Klasse EUR	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht Mwährungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3*	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	37.248	–	62.071	15.459	–	903.522
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.074	927	127.259	1.883.989	2.515.374	801.702
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.825)	–	(57.068)	(1.720.504)	(73.165)	(642.454)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	34.497	927	132.262	178.944	2.442.209	1.062.770
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	71.488	–	8.190	1.664	–	399.122
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	35.142	–	57.805	17.075	–	578.110
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(69.382)	–	(3.924)	(3.280)	–	(73.710)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	37.248	–	62.071	15.459	–	903.522

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Ultra Short Term Euro Bond

	Thesaurierende Klasse CHF P*	Thesaurierende Klasse CHF U	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse EUR U	Thesaurierende Klasse EUR Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	20.604	88.648	6.724.282	5.457	556.414	2.214.472	252	59.498	597.498
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.900	68.248	73.875	5.559.527	10.872	202.752	149.283	566	23.401	447.028
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(22.256)	(108.566)	(7.190.852)	(462)	(257.612)	(723.293)	(12)	(42.066)	(1.022.170)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.900	66.596	53.957	5.092.957	15.867	501.554	1.640.462	806	40.833	22.356
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	20.294	–	1.770.328	4.407	556.414	1.415.964	–	3.754	2.701
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	4.825	121.213	7.552.260	1.086	–	998.749	252	58.894	918.045
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(4.515)	(32.565)	(2.598.306)	(36)	–	(200.241)	–	(3.150)	(323.248)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	20.604	88.648	6.724.282	5.457	556.414	2.214.472	252	59.498	597.498

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD M*	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	40.059	–	805.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	144.957	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(160.570)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	24.446	–	805.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	297	473.578
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	141.120	–	366.063
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(101.061)	(297)	(34.641)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	40.059	–	805.000

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies

	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I5	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P*	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	522.520	47.000	5.650.747	30.954.859	1.254.213	916.447	61.124	–	5.450.362	65.191.635
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	93.716	92.713	1.954.523	10.782.886	373.070	218.897	129.902	3.670.532	3.885.691	26.424.053
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(284.532)	–	(4.406.682)	(26.779.210)	(226.221)	(520.527)	(22.735)	(781.869)	(2.618.823)	(15.746.219)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	331.704	139.713	3.198.588	14.958.535	1.401.062	614.817	168.291	2.888.663	6.717.230	75.869.469
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	366.400	47.000	1.928.848	15.495.970	1.060.593	804.031	125.509	–	6.576.046	39.409.055
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	170.540	–	5.421.575	24.133.849	347.541	156.080	2.995	–	1.709.727	31.834.746
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(14.420)	–	(1.699.676)	(8.674.960)	(153.921)	(43.664)	(67.380)	–	(2.835.411)	(6.052.166)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	522.520	47.000	5.650.747	30.954.859	1.254.213	916.447	61.124	–	5.450.362	65.191.635

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I2*	Thesaurierende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse JPY I*	Thesaurierende Klasse SGD A*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	11.930.455	45.118.664	40.900	–	–	3.687.353	841.285	14.516.127	6.375.720
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.661	11.079.640	44.868.761	813	4.210.727	10.011	5.207.190	–	9.221.872	807.263
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(26)	(2.198.847)	(24.231.745)	–	–	–	(2.001.280)	(176.873)	(2.547.861)	(2.222.197)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.635	20.811.248	65.755.680	41.713	4.210.727	10.011	6.893.263	664.412	21.190.138	4.960.786
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	11.432.063	27.212.188	36.327	–	3.518	5.329.041	1.515.078	8.714.241	5.177.899
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.388.591	35.123.445	9.394	–	–	1.422.690	26.144	9.066.169	1.757.094
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(1.890.199)	(17.216.969)	(4.821)	–	(3.518)	(3.064.378)	(699.937)	(3.264.283)	(559.273)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	11.930.455	45.118.664	40.900	–	–	3.687.353	841.285	14.516.127	6.375.720

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.529.220	871.364	616.287	829.875
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	453.543	933.686	5.246.410	1.463.217
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(62.374)	(507.136)	(1.205.712)	(36.383)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.920.389	1.297.914	4.656.985	2.256.709
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.435.193	1.317.146	3.738.682	263.401
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	317.468	219.286	691.261	901.545
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(223.441)	(665.068)	(3.813.656)	(335.071)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.529.220	871.364	616.287	829.875

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

XXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse USD X*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	67.400.238	2.685.584
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.370.315)	(867.005)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	66.029.923	1.818.579

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Equity

	Thesaurierende Klasse JPY I3*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	61.736	55.448	229.104	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.341.989	199.320	124.911	–	1.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.449)	(33.741)	(29.719)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.336.540	227.315	150.640	229.104	1.000
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	58.114	22.895	227.796	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	54.045	40.807	1.308	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(50.423)	(8.254)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	61.736	55.448	229.104	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I3*	Thesaurierende Klasse EUR I4	Thesaurierende Klasse EUR M währungsgesichert	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I3*	Ausschüttende Klasse GBP I3*	Thesaurierende Klasse GBP I4*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	47.525	220.080	180.864	33.905	1.802.720	2.248.157	3.198.627	846
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	11.664	425.297	422	–	1.340.219	4.553.797	19.638.605	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(14.728)	(96.117)	(115.238)	(6.403)	(715.251)	(529.835)	(1.560.470)	(846)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	44.461	549.260	66.048	27.502	2.427.688	6.272.119	21.276.762	–
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	50.474	–	200.811	34.986	199.859	–	–	129.956
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	17.817	220.080	4.580	4.862	3.418.951	2.430.290	3.214.227	500
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(20.766)	–	(24.527)	(5.943)	(1.816.090)	(182.133)	(15.600)	(129.610)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	47.525	220.080	180.864	33.905	1.802.720	2.248.157	3.198.627	846

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I4 Ausschüttende (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I4* währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1*	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.895.632	786	287.113	10.180	911.802	–	1.127.931
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.547.300	–	358.721	4.767	500.722	–	692.990
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.056.749)	(786)	(187.360)	(5.242)	(461.805)	–	(723.111)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.386.183	–	458.474	9.705	950.719	–	1.097.810
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.136.552	786	–	4.747	836.744	14.636	321.703
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.512.226	–	287.240	92.462	3.060.682	13.517	974.579
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(753.146)	–	(127)	(87.029)	(2.985.624)	(28.153)	(168.351)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	8.895.632	786	287.113	10.180	911.802	–	1.127.931

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3*	Ausschüttende Klasse USD I3*	Thesaurierende Klasse USD I4	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P*	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.539.876	849	1.053.159	1.879.518	107.362	–	2.855.112
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.088.996	–	1.203.212	1.407.434	15.269	–	632.431
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.604.125)	(849)	(213.715)	(2.901.073)	(24.474)	–	(775.364)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.024.747	–	2.042.656	385.879	98.157	–	2.712.179
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>							
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.568.934	68.247	–	2.581.227	83.101	997	1.253.566
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.012.718	849	1.054.178	58.482	53.242	–	1.974.431
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.041.776)	(68.247)	(1.019)	(760.191)	(28.981)	(997)	(372.885)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.539.876	849	1.053.159	1.879.518	107.362	–	2.855.112

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*	
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–	–	
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	13.958	39.526	1.627.094	4.250.285	1.491.188	13.047.025	2.528	843	2.528	843
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(158.890)	(282.301)	(54.445)	(1.788.412)	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.958	39.526	1.468.204	3.967.984	1.436.743	11.258.613	2.528	843	2.528	843

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP P* (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	200.000	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	73.478.088	102.520	2.678	8.502.130	5.636	7.269.038	41.035.790	5.929.016	5.300	5.418.346
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.203.212)	(630)	–	(877.681)	(35)	(514.469)	(5.239.297)	(172.341)	–	(241.743)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	70.274.876	101.890	2.678	7.624.449	5.601	6.754.569	35.996.493	5.756.675	5.300	5.176.603
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	200.000	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	200.000	–	–	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z*
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.344.067
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.344.067

## US Long Short Equity

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht Währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	143.682	4.846.206	11.178.440	2.771	377.171
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	172.023	326.393	783.023	–	13.018
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(258.630)	(1.904.149)	(8.522.191)	(2.771)	(73.636)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	57.075	3.268.450	3.439.272	–	316.553
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	125.105	4.750.069	9.193.163	2.771	501.338
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	19.851	2.866.338	5.099.388	–	61.810
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.274)	(2.770.201)	(3.114.111)	–	(185.977)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	143.682	4.846.206	11.178.440	2.771	377.171

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP I3	Thesaurierende Klasse SGD A1	Thesaurierende Klasse USD A (PF)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD A1
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.455	225.433	22.176	227.237	1.487.680	1.253.410
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.183	4.879	5.032	21.487	276.405	214.886
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.638)	(175.460)	(14.494)	(15.031)	(499.064)	(373.550)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	54.852	12.714	233.693	1.265.021	1.094.746
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	13.835	95.959	19.884	96.616	766.212	1.168.843
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	313.747	12.173	146.970	951.887	205.228
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(11.380)	(184.273)	(9.881)	(16.349)	(230.419)	(120.661)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.455	225.433	22.176	227.237	1.487.680	1.253.410

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1*	Ausschüttende Klasse USD I (PF)	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD U
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	2.802.577	2.090.293	10.442.455	109.302	542.601
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	375.719	3.885.914	1.985.919	2.738	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(536.072)	(2.301.510)	(11.241.522)	(94)	(7.826)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	2.642.224	3.674.697	1.186.852	111.946	534.775
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.001	2.894.075	1.950.439	7.437.151	78.974	559.790
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.243.110	675.873	6.122.291	32.576	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.001)	(1.334.608)	(536.019)	(3.116.987)	(2.248)	(17.189)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	2.802.577	2.090.293	10.442.455	109.302	542.601

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	419.811
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	75.111
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(227.565)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	267.357
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>	
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	590.818
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(171.007)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	419.811

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities

	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR1 A
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	103.392	105.957	84.141	34.214	85.750
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	49.631	38.631	–	2.346	15.445
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(59.237)	(34.232)	–	(5.564)	(23.159)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	93.786	110.356	84.141	30.996	78.036
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	47.784	34.193	121.430	44.608	62.049
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	220.948	142.492	–	2.895	36.641
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(165.340)	(70.728)	(37.289)	(13.289)	(12.940)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	103.392	105.957	84.141	34.214	85.750



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR1 Iwährungsgesichert	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht Iwährungsgesichert)	Thesaurierende Klasse SGD A
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	154.894	73.977	542.847
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	67.811	–	242.498
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(96.949)	(72.912)	(205.723)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	125.756	1.065	579.622
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>			
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	425.335	1.065	548.759
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.913	72.912	490.121
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(276.354)	–	(496.033)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	154.894	73.977	542.847

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E	Thesaurierende Klasse USD I3
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	865.824	175.037	61.643	713.406	1.368.306
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.269.038	–	34.603	594.543	3.413
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.327.781)	(38.867)	(52.691)	(583.379)	(487.998)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	807.081	136.170	43.555	724.570	883.721
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>					
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	326.687	187.510	108.172	240.820	1.665.178
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.556.179	16.112	180.937	1.136.247	20.646
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.017.042)	(28.585)	(227.466)	(663.661)	(317.518)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	865.824	175.037	61.643	713.406	1.368.306

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P*	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse USD1 A	Thesaurierende Klasse USD1 I	Ausschüttende Klasse USD1 I
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	275.603	2.743.383	–	685.660	2.287.465	11.728	2.606.938	9.791.044	254.798
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	162.523	–	715.901	32.378	1.213	1.106.851	2.335.683	26.230
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(60.197)	(2.441.290)	–	(451.221)	(262.621)	–	(1.368.392)	(6.360.738)	(106.853)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	215.406	464.616	–	950.340	2.057.222	12.941	2.345.397	5.765.989	174.175
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	265.913	3.742.145	1.167	189.393	2.627.300	4.783	3.058.915	8.479.834	177.421
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	17.599	199.750	–	1.225.294	2.123	7.181	1.080.409	3.210.858	143.070
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.909)	(1.198.512)	(1.167)	(729.027)	(341.958)	(236)	(1.532.386)	(1.899.648)	(65.693)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	275.603	2.743.383	–	685.660	2.287.465	11.728	2.606.938	9.791.044	254.798

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR B	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Thesaurierende Klasse ZAR E	Thesaurierende Klasse ZAR T
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	146.610	7.079	239.157	165.854
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	242.602	233	159.012	259.962
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(218.148)	(4.533)	(151.167)	(205.856)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	171.064	2.779	247.002	219.960
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>				
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	172.335	17.199	144.937	90.715
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	690.654	56.377	506.303	296.826
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(716.379)	(66.497)	(412.083)	(221.687)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	146.610	7.079	239.157	165.854

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD B	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD C2*	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD E	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	547.802	528.145	159.224	9.268	4.628	226.887	131.627	370.189
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	561.190	401.435	139.425	182	744	157.592	110.452	491.866
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(433.260)	(437.029)	(160.362)	(7.643)	(5.372)	(139.155)	(120.731)	(399.091)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	675.732	492.551	138.287	1.807	–	245.324	121.348	462.964
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	85.602	242.139	223.108	17.127	12.057	157.410	91.912	251.422
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	816.335	976.713	392.929	13.209	5.830	339.555	307.917	697.480
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(354.135)	(690.707)	(456.813)	(21.068)	(13.259)	(270.078)	(268.202)	(578.713)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	547.802	528.145	159.224	9.268	4.628	226.887	131.627	370.189

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	348.355	145.606	221.920	2.188.596	27.810	7.690.618
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	186.159	7.970	808.215	115.823	27.222	3.362.015
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(166.094)	(13.695)	(896.614)	(1.753.438)	(6.272)	(3.891.802)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	368.420	139.881	133.521	550.981	48.760	7.160.831
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	192.882	138.206	131.273	636.897	5.316	1.908.624
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	777.489	37.500	2.308.782	2.016.770	23.131	11.027.949
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(622.016)	(30.100)	(2.218.135)	(465.071)	(637)	(5.245.955)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	348.355	145.606	221.920	2.188.596	27.810	7.690.618

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende		Ausschüttende		Ausschüttende		Ausschüttende	
	Thesaurierende	Klasse	Thesaurierende	Ausschüttende	Klasse	Thesaurierende	Thesaurierende	Klasse
	Klasse	USD A	Klasse	Klasse	USD B	Klasse	Klasse	USD C2
	SGD A	(Monatlich)	USD A	USD A	(Monatlich)	USD B	USD C1	(Monatlich)
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	41.774	4.190.452	10.643.671	1.003.155	2.658.868	1.533.723	1.778.770	59.343
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	54.661	1.521.105	3.000.057	98.848	2.723.404	2.264.820	–	29.337
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(67.911)	(2.286.148)	(3.633.809)	(176.973)	(2.853.995)	(2.519.396)	(549.024)	(55.337)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	28.524	3.425.409	10.009.919	925.030	2.528.277	1.279.147	1.229.746	33.343
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	5.146	1.093.177	5.062.334	252.301	1.530.727	701.983	1.673.052	77.096
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	75.224	4.899.154	8.068.909	838.558	4.840.076	4.871.040	518.163	274.462
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(38.596)	(1.801.879)	(2.487.572)	(87.704)	(3.711.935)	(4.039.300)	(412.445)	(292.215)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	41.774	4.190.452	10.643.671	1.003.155	2.658.868	1.533.723	1.778.770	59.343

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende		Ausschüttende		Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD M
	Thesaurierende Klasse USD C2	Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Klasse USD I (Monatlich)				
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	36.053	1.226.573	1.350.073	27.397	5.679.976	516.818	84.179	4.177.044
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	32.134	1.183.941	872.491	539	2.502.125	96.207	891.081	1.015.838
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(42.508)	(1.250.772)	(1.296.797)	(4.677)	(2.568.435)	(60.991)	(79.555)	(1.563.575)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	25.679	1.159.742	925.767	23.259	5.613.666	552.034	895.705	3.629.307
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	86.347	880.416	871.106	6.351	3.157.489	68.073	44.896	1.460.437
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	222.237	2.220.575	2.890.383	26.454	4.566.947	501.210	74.153	3.420.957
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(272.531)	(1.874.418)	(2.411.416)	(5.408)	(2.044.460)	(52.465)	(34.870)	(704.350)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	36.053	1.226.573	1.350.073	27.397	5.679.976	516.818	84.179	4.177.044



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende			Ausschüttende			Ausschüttende		
	Klasse	Thesaurierende	Thesaurierende	Klasse	Thesaurierende	Klasse	Thesaurierende	Klasse	Thesaurierende
	USD T	Klasse	Klasse	ZAR B	Klasse	ZAR C2	Klasse	ZAR E	Klasse
	(Monatlich)	USD T	USD Z	(Monatlich)	ZAR B	(Monatlich)	ZAR C2	(Monatlich)	ZAR E
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.360.408	1.316.547	442.390	1.178.531	209.941	51.876	6.127	718.416	124.544
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.053.254	1.224.710	281	1.079.663	209.050	11.624	154	1.475.483	162.432
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.081.033)	(1.336.013)	(248.176)	(1.040.179)	(221.973)	(37.337)	(325)	(1.552.107)	(132.827)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.332.629	1.205.244	194.495	1.218.015	197.018	26.163	5.956	641.792	154.149
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>									
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	362.687	544.136	434.300	625.282	251.362	56.846	6.757	248.603	107.586
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.804.679	3.978.618	64.061	1.704.950	877.706	102.931	48.079	1.538.861	418.445
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.806.958)	(3.206.207)	(55.971)	(1.151.701)	(919.127)	(107.901)	(48.709)	(1.069.048)	(401.487)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.360.408	1.316.547	442.390	1.178.531	209.941	51.876	6.127	718.416	124.544

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR T
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	799.891	158.545
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	572.158	221.048
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(510.352)	(165.682)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	861.697	213.911
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>		
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	378.992	93.125
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.387.434	558.645
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.966.535)	(493.225)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	799.891	158.545

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap

	Thesaurierende Klasse AUD B	Thesaurierende Klasse AUD C2	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)*		
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	140.649	1.166	118.110	100.934	176.331	17.463	656.580	271.757	1.299.867	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	128.598	680	27.564	58.608	80.686	14.654	365.442	577.331	251.023	7.311.198
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(161.074)	(156)	(47.845)	(47.695)	(108.858)	(2.907)	(832.341)	(637.725)	(83.062)	(3.439.500)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	108.173	1.690	97.829	111.847	148.159	29.210	189.681	211.363	1.467.828	3.871.698
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>										
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	72.237	4.984	74.642	46.350	29.489	2.531	156.645	48.463	1.174.982	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	281.478	5.413	264.021	158.030	1.290.108	2.426.525	633.529	249.359	286.274	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(213.066)	(9.231)	(220.553)	(103.446)	(1.143.266)	(2.411.593)	(133.594)	(26.065)	(161.389)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	140.649	1.166	118.110	100.934	176.331	17.463	656.580	271.757	1.299.867	–

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Zwährungsgesichert	Ausschüttende Klasse JPY I (nicht Zwährungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	9.727	18.640	1.123.196.288	6.258.516	727.056	460.497	7.917	358.092
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.123	255	232.598.449	553.685	78.375	595.156	12.727	176.074
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(92)	–	(454.338.756)	(2.865.403)	(147.427)	(667.374)	(17.260)	(372.873)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.758	18.895	901.455.981	3.946.798	658.004	388.279	3.384	161.293
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	5.110	10.344	975.502.131	3.616.378	306.225	481.942	22.307	207.946
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.744	8.395	527.139.765	6.016.832	470.886	1.842.700	221.434	1.222.570
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.127)	(99)	(379.445.608)	(3.374.694)	(50.055)	(1.864.145)	(235.824)	(1.072.424)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.727	18.640	1.123.196.288	6.258.516	727.056	460.497	7.917	358.092

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse ZAR E	Thesaurierende Klasse ZAR T
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.891.915	1.485.829	5.040	3.928.128	337.309	145.644	75.771	133.102
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.782.275	101.087	7.022	80.513	213.833	–	49.994	73.599
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.291.860)	(468.419)	(4.566)	(3.830.850)	(186.785)	(24.810)	(44.404)	(110.421)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	8.382.330	1.118.497	7.496	177.791	364.357	120.834	81.361	96.280
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>								
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.209.826	675.696	7.898	3.638.055	238.124	9.204	92.504	100.698
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.309.894	873.399	–	1.598.841	922.217	138.231	463.073	436.002
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.627.805)	(63.266)	(2.858)	(1.308.768)	(823.032)	(1.791)	(479.806)	(403.598)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.891.915	1.485.829	5.040	3.928.128	337.309	145.644	75.771	133.102

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Small Cap Intrinsic Value

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I <sup>2</sup> (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I <sup>2</sup> *	Thesaurierende Klasse USD M
<b>Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.966.688	882.278	374.861	4.798.391	–	28.431
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.144.051	636.778	168.042	838.670	3.900.000	5.075
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(904.451)	(104.676)	(81.383)	(572.726)	–	(1.980)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.206.288	1.414.380	461.520	5.064.335	3.900.000	31.526
<b>Für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr</b>						
<b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	110.572	5.653.886	–	727
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.122.998	885.623	291.969	974.909	–	29.712
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(156.310)	(3.345)	(27.680)	(1.830.404)	–	(2.008)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.966.688	882.278	374.861	4.798.391	–	28.431

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE**

Der Manager hat für jede Klasse Anspruch auf eine Gebühr in Bezug auf Managementdienste, die er für jedes Portfolio erbringt (die „Managementgebühr“). Darüber hinaus hat der Manager Anspruch auf eine Gebühr von 0,025 % in Bezug auf die von ihm der Gesellschaft bereitgestellten administrativen Supportdienste. Diese Gebühr ist auf 0,20 % pro Anteilklasse begrenzt.

Die maximale jährliche Gebühr, die der Gesellschaft in Bezug auf ein Portfolio in Rechnung gestellt wird, beträgt 2,5 % seines NIW. Die aktuelle Managementgebühr, die in Bezug auf jedes Portfolio zahlbar ist, wird im betreffenden Nachtrag veröffentlicht. Die aktuellen Sätze für die Managementgebühr der einzelnen Anlageklassen sind nachstehend aufgeführt.

Die Managementgebühr läuft täglich auf und ist monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats zahlbar. Sofern im Nachtrag des betreffenden Portfolios keine anders lautenden Angaben gemacht werden, bezahlt der Manager die in Bezug auf ein Portfolio bestellten Sub-Investment-Manager oder Anlageberater aus seiner Managementgebühr. Der Manager hat ferner Anspruch auf Erstattung aller Spesen durch die Gesellschaft, die ihm (oder seinen Beauftragten) bei der Erfüllung seiner (ihrer) Pflichten entstehen, und zahlt diese erstatteten Spesen an den jeweiligen Dienstleister.

<b>5G Connectivity</b>	<b>Management- gebühr</b>	<b>Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)</b>	<b>Management- gebühr</b>
Thesaurierende Klasse AUD A	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse CNY A	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD X	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %		
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,85 %	<b>China A-Share Equity</b>	
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,43 %	Thesaurierende Klasse CNY I	0,90 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,90 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,70 %	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,90 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,85 %		
Thesaurierende Klasse HKD A	1,70 %	<b>China Bond</b>	
Thesaurierende Klasse SGD A	1,70 %	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %	Thesaurierende Klasse CNY Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %	Ausschüttende Klasse CNY I	0,65 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,85 %	Thesaurierende Klasse GBP I2	0,52 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,68 %	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,60 %	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,65 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,43 %	Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %		
		<b>China Equity</b>	
<b>Asian Debt - Hard Currency</b>		Thesaurierende Klasse CHF I	1,10 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %	Thesaurierende Klasse EUR A	1,85 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %	Thesaurierende Klasse EUR I	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,20 %	Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %	Ausschüttende Klasse GBP A	1,85 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %	Thesaurierende Klasse SGD A	1,85 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,36 %	Thesaurierende Klasse USD A	1,85 %
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	0,36 %	Ausschüttende Klasse USD A	1,85 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)	Management- gebühr	Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse USD I	1,10 %	Thesaurierende Klasse GBP I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,88 %	Thesaurierende Klasse GBP I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,85 %	Ausschüttende Klasse GBP I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,45 %	Thesaurierende Klasse GBP P	0,57 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse GBP P	0,57 %
		Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,20 %
<b>CLO Income</b>		Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %	Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,75 %	Ausschüttende Klasse USD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,60 %	Thesaurierende Klasse USD C1	1,20 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,60 %	Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse SEK I	0,75 %	Thesaurierende Klasse USD I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %	Ausschüttende Klasse USD I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %	Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,60 %	Ausschüttende Klasse USD M	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,38 %	Thesaurierende Klasse USD P	0,57 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>Commodities</b>		<b>Emerging Market Debt- Hard Currency</b>	
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,65 %	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,40 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,33 %	Ausschüttende Klasse AUD I	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,40 %	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	0,49 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,65 %	Thesaurierende Klasse CHF I2	0,56 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,33 %	Thesaurierende Klasse CHF P	0,67 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,40 %	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,40 %
		Thesaurierende Klasse EUR A	1,40 %
<b>Corporate Hybrid Bond</b>		Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,20 %	Ausschüttende Klasse EUR I	0,70 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,57 %	Thesaurierende Klasse EUR I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse CHF P	0,57 %	Ausschüttende Klasse EUR I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,20 %	Thesaurierende Klasse EUR I3	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,20 %	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %	Thesaurierende Klasse EUR I4	0,42 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,60 %	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,35 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,48 %	Thesaurierende Klasse EUR M	1,40 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,48 %	Ausschüttende Klasse EUR M	1,40 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,42 %	Thesaurierende Klasse EUR P	0,67 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,30 %	Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %	Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,20 %	Ausschüttende Klasse GBP I	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,57 %	Thesaurierende Klasse GBP I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse EUR P	0,57 %	Ausschüttende Klasse GBP I2	0,56 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

<b>Emerging Market Debt- Hard Currency (Fortsetzung)</b>	<b>Management- gebühr</b>	<b>Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)</b>	<b>Management- gebühr</b>
Thesaurierende Klasse GBP P	0,67 %	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,40 %	Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,70 %	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,40 %	Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse SEK I2	0,56 %	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,40 %	Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,40 %	Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,40 %	Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,40 %	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,40 %	Thesaurierende Klasse USD I2	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %	Thesaurierende Klasse USD I5	0,38 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,70 %	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,56 %	Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,56 %	Thesaurierende Klasse USD X	0,38 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,49 %	Thesaurierende Klasse USD Y	0,36 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,40 %	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,40 %	Thesaurierende Klasse ZAR B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,67 %	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,47 %	Thesaurierende Klasse ZAR C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	1,80 %
		Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
		Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,80 %
		Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %
		<b>Emerging Market Debt Blend</b>	
		Ausschüttende Klasse AUD I3	0,49 %
		Thesaurierende Klasse EUR A	1,40 %
		Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %
		Ausschüttende Klasse EUR I	0,70 %
		Thesaurierende Klasse EUR I2	0,56 %
		Ausschüttende Klasse EUR I2	0,56 %
		Ausschüttende Klasse EUR I3	0,49 %
		Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,42 %
		Thesaurierende Klasse EUR I5	0,35 %
		Thesaurierende Klasse EUR M	1,40 %
		Ausschüttende Klasse EUR M	1,40 %
		Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
		Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %
		Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
		Ausschüttende Klasse GBP I	0,70 %
		Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
		Thesaurierende Klasse GBP P	0,67 %
		Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,67 %
		Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse NOK U	1,05 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,40 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,40 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,56 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,49 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,40 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>Emerging Market Debt Sustainable</b>	
Investment Grade Blend	
Thesaurierende Klasse AUD I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse NOK I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>Emerging Markets Equity</b>	
Thesaurierende Klasse AUD B	2,00 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	2,00 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,00 %
Thesaurierende Klasse AUD T	2,00 %
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	1,00 %
Ausschüttende Klasse CAD I2	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,00 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I	1,00 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD T	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse ZAR B	2,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	2,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	2,00 %
<b>Emerging Markets Select Equity</b>	
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,43 %
<b>Euro Bond Absolute Return</b>	
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,23 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,45 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,45 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>Euro Opportunistic Bond</b>	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,35 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,35 %
<b>European High Yield Bond</b>	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,20 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>European Sustainable Equity</b>	
Ausschüttende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	1,50 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Event Driven	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,50 %
Ausschüttende Klasse GBP I5	0,50 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,95 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,50 %

Global Bond	
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD C1	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD M	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	0,75 %

Global Diversified Income FMP – 2024	
Thesaurierende Klasse EUR A	0,75 %
Ausschüttende Klasse EUR A	0,75 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,35 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,35 %
Ausschüttende Klasse HKD A	0,75 %
Ausschüttende Klasse SGD A	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD A	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,35 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,35 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD X	0,40 %

Global Equity Megatrends	
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Flexible Credit Income	
Thesaurierende Klasse CAD I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,30 %

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global High Yield SDG Engagement	
Ausschüttende Klasse AUD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,37 %
Ausschüttende Klasse CHF I4	0,37 %
Thesaurierende Klasse CHF X	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,37 %
Ausschüttende Klasse EUR I4	0,37 %
Thesaurierende Klasse EUR X	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	0,10 %
Thesaurierende Klasse GBP I4	0,37 %
Thesaurierende Klasse GBP X	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,37 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global High Yield Sustainable Action	
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD Y	0,18 %

Global Investment Grade Credit	
Thesaurierende Klasse USD I	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,10 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Opportunistic Bond	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,30 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,29 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,30 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,24 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities	Management- gebühr	High Yield Bond (Fortsetzung)	Management- gebühr
Ausschüttende Klasse EUR I5	0,38 %	Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %	Ausschüttende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,00 %	Thesaurierende Klasse EUR I2	0,50 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse EUR I2	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %	Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD CI	1,50 %	Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,38 %	Thesaurierende Klasse GBP A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %	Ausschüttende Klasse GBP A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Thesaurierende Klasse GBP I	0,60 %
		Ausschüttende Klasse GBP I	0,60 %
		Thesaurierende Klasse GBP I2	0,50 %
		Ausschüttende Klasse GBP I2	0,50 %
		Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
		Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,20 %
		Thesaurierende Klasse SEK A	1,20 %
		Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,20 %
		Thesaurierende Klasse SGD A	1,20 %
		Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
		Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	1,20 %
		Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
		Ausschüttende Klasse USD A	1,20 %
		Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	1,80 %
		Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
		Thesaurierende Klasse USD C	0,80 %
		Thesaurierende Klasse USD C1	1,20 %
		Ausschüttende Klasse USD C1	1,20 %
		Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	1,80 %
		Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
		Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	1,80 %
		Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
		Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,60 %
		Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
		Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
		Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	0,50 %
		Thesaurierende Klasse USD I2	0,50 %
		Ausschüttende Klasse USD I2	0,50 %
		Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	0,36 %
		Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
		Ausschüttende Klasse USD M	1,20 %
		Thesaurierende Klasse USD P	0,57 %
		Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,80 %
		Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	1,80 %
		Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
<b>Global Sustainable Equity</b>			
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,30 %		
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,50 %		
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,00 %		
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,60 %		
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,30 %		
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %		
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %		
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %		
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %		
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %		
<b>High Yield Bond</b>			
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,20 %		
Thesaurierende Klasse AUD A	1,20 %		
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	1,80 %		
Thesaurierende Klasse AUD B	1,80 %		
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	1,80 %		
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	1,80 %		
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %		
Ausschüttende Klasse AUD I	0,60 %		
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,80 %		
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	1,80 %		
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %		
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,20 %		
Thesaurierende Klasse CHF A	1,20 %		
Thesaurierende Klasse CHF I	0,60 %		
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,50 %		
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,20 %		
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	0,60 %		
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,20 %		
Thesaurierende Klasse EUR A	1,20 %		
Ausschüttende Klasse EUR A	1,20 %		

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)	Management- gebühr	Multi-Asset Income	Management- gebühr
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	0,90 %	Ausschüttende Klasse GBP P	0,62 %
Thesaurierende Klasse USD U	0,90 %	Thesaurierende Klasse USD A	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Thesaurierende Klasse USD C1	1,30 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	1,80 %	Thesaurierende Klasse USD I	0,65 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	1,80 %	Ausschüttende Klasse USD I	0,65 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	1,80 %	Thesaurierende Klasse USD M	1,30 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %		
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,80 %	<b>Next Generation Mobility</b>	
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %	Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %
		Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %
<b>InnovAsia 5G</b>		Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,51 %	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,51 %	Thesaurierende Klasse USD C1	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR X	1,45 %	Ausschüttende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse SGD I4	0,51 %	Thesaurierende Klasse USD X	1,55 %
Thesaurierende Klasse SGD X	1,45 %		
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %	<b>Next Generation Space Economy</b>	
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,51 %	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %	Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,45 %		
		<b>Short Duration Emerging Market Debt</b>	
<b>Japan Equity Engagement</b>		Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,00 %
Ausschüttende Klasse EUR I5	0,43 %	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,43 %	Thesaurierende Klasse CHF A	1,00 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,81 %	Ausschüttende Klasse CHF A	1,00 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,85 %	Thesaurierende Klasse CHF I	0,50 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,85 %	Ausschüttende Klasse CHF I	0,50 %
Thesaurierende Klasse JPY I5	0,43 %	Thesaurierende Klasse CHF I2	0,40 %
Thesaurierende Klasse JPY Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse CHF I2	0,40 %
		Thesaurierende Klasse CHF I5	0,25 %
<b>Macro Opportunities FX</b>		Thesaurierende Klasse CHF P	0,48 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %	Thesaurierende Klasse EUR A	1,00 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse EUR A	1,00 %
Thesaurierende Klasse SEK I	0,60 %	Thesaurierende Klasse EUR I	0,50 %
Ausschüttende Klasse SEK I	0,60 %	Ausschüttende Klasse EUR I	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %	Thesaurierende Klasse EUR I2	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Ausschüttende Klasse EUR I2	0,40 %
		Thesaurierende Klasse EUR I5	0,25 %
		Thesaurierende Klasse EUR M	1,00 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)	Management- gebühr	Systematic Global Sustainable Value (Fortsetzung)	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %	Thesaurierende Klasse USD I	0,45 %
		Thesaurierende Klasse USD I3	0,32 %
		Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>Sustainable Asia High Yield</b>			
Thesaurierende Klasse EUR X	0,40 %		
Thesaurierende Klasse GBP X	0,40 %		
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %		
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %		
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %		
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %		
Ausschüttende Klasse USD Z	0,00 %		
<b>Sustainable Emerging Market Corporate Debt</b>			
Thesaurierende Klasse CHF I	0,80 %		
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,48 %		
Thesaurierende Klasse EUR A	1,60 %		
Thesaurierende Klasse EUR I	0,80 %		
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,48 %		
Thesaurierende Klasse EUR M	1,60 %		
Ausschüttende Klasse EUR M	1,60 %		
Thesaurierende Klasse EUR X	0,46 %		
Thesaurierende Klasse GBP I	0,80 %		
Thesaurierende Klasse SEK A	1,60 %		
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,60 %		
Thesaurierende Klasse USD A	1,60 %		
Thesaurierende Klasse USD C1	1,60 %		
Thesaurierende Klasse USD I	0,80 %		
Ausschüttende Klasse USD I	0,80 %		
Thesaurierende Klasse USD I2	0,64 %		
Thesaurierende Klasse USD I5	0,40 %		
Thesaurierende Klasse USD M	1,60 %		
Ausschüttende Klasse USD M	1,60 %		
<b>Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency</b>			
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,49 %		
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,35 %		
Thesaurierende Klasse EUR X	0,35 %		
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %		
Thesaurierende Klasse USD I5	0,35 %		
<b>Systematic Global Sustainable Value</b>			
Thesaurierende Klasse EUR M	0,90 %		
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,23 %		
Thesaurierende Klasse USD A*	0,90 %		
		<b>Ultra Short Term Euro Bond</b>	
		Thesaurierende Klasse CHF P	0,18 %
		Thesaurierende Klasse CHF U	0,29 %
		Thesaurierende Klasse EUR I5	0,09 %
		Thesaurierende Klasse EUR A	0,38 %
		Thesaurierende Klasse EUR I	0,19 %
		Ausschüttende Klasse EUR I	0,19 %
		Thesaurierende Klasse EUR I2	0,15 %
		Thesaurierende Klasse EUR M	0,38 %
		Thesaurierende Klasse EUR U	0,29 %
		Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
		Thesaurierende Klasse USD I	0,19 %
		Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
		<b>Uncorrelated Strategies</b>	
		Thesaurierende Klasse CHF I	0,75 %
		Thesaurierende Klasse CHF I5	0,38 %
		Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %
		Thesaurierende Klasse EUR I	0,75 %
		Thesaurierende Klasse EUR I2	0,60 %
		Thesaurierende Klasse EUR I5	0,38 %
		Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %
		Thesaurierende Klasse EUR P	0,71 %
		Thesaurierende Klasse GBP I	0,75 %
		Thesaurierende Klasse GBP I2	0,60 %
		Ausschüttende Klasse GBP I2	0,60 %
		Thesaurierende Klasse GBP I5	0,38 %
		Thesaurierende Klasse GBP P	0,71 %
		Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
		Thesaurierende Klasse JPY I	0,75 %
		Thesaurierende Klasse SGD A	1,50 %
		Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
		Thesaurierende Klasse USD C1	1,50 %
		Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
		Thesaurierende Klasse USD I2	0,60 %
		Thesaurierende Klasse USD I5	0,38 %
		Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
		Thesaurierende Klasse USD P	0,71 %
		Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

XXXXXXXXXXXX	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse EUR X	0,65 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,65 %
<b>US Equity</b>	
Thesaurierende Klasse JPY I3	0,53 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
<b>US Equity Index PutWrite</b>	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,36 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I3	0,42 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,36 %
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,57 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,36 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>US Large Cap Value</b>	
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,35 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,42 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,67 %
Ausschüttende Klasse GBP P	0,67 %

US Large Cap Value (Fortsetzung)	Management- gebühr
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,63 %
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,63 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I4	0,42 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,35 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>US Long Short Equity</b>	
Thesaurierende Klasse EUR A	2,25 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,35 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,95 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,25 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	0,95 %
Thesaurierende Klasse SGD A1	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD A (PF)	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,25 %
Thesaurierende Klasse USD A1	2,00 %
Ausschüttende Klasse USD I (PF)	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,35 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,95 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,25 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
<b>US Multi Cap Opportunities</b>	
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse EUR 1A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR 1I	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	0,50 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD 1A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD 1I	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD 1I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,50 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)	Management- gebühr
Ausschüttende Klasse USD I3	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,25 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

US Real Estate Securities	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,50 %
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD B	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,50 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,54 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

US Real Estate Securities (Fortsetzung)	Management- gebühr
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

US Small Cap	
Thesaurierende Klasse AUD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

US Small Cap Intrinsic Value	
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

Gegebenenfalls wird auf die o. g. Gebühren ein Rabatt eingeräumt.

Der Manager kann auf seine Gebühren verzichten, um die Gesamtkostenquoten („TERs“) der Portfolios nach oben zu begrenzen. Diese Gebührenverzichtete sind freiwillig und können vom Manager jederzeit ohne vorherige Mitteilung zurückgenommen werden. Gebühren, auf die freiwillig verzichtet wurde, können nicht vom Manager zurückgefordert werden. Eine Aufgliederung der TERs der einzelnen Portfolios ist in Anhang I enthalten.

Die Gesellschaft bezahlt Verwaltungsgebühren, die nicht mehr als 0,20 % des NIW des betreffenden Portfolios betragen werden. Die Verwaltungsgebühr setzt sich zusammen aus einer Gebühr, die an die Verwaltungsstelle für die von ihr in Bezug auf jedes Portfolio erbrachten Verwaltungsdienste zu zahlen ist, und einer Gebühr, die an den Manager für die von ihm für jedes Portfolio erbrachten administrativen Supportdienste zu zahlen ist; sie läuft monatlich auf und ist monatlich rückwirkend zu zahlen.

Der Fonds zahlt an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage der Bewertung des Nettovermögens des Uncorrelated Strategies und XXXXXXXXXXXX am Monatsende mit den folgenden Sätzen:

Vermögenswerte von 0 – 500 Mio. US\$	0,055 %
Vermögenswerte von 500 – 2.000 Mio. US\$	0,05 %
Vermögenswerte über 2.000 Mio. US\$	0,04 %

Der Fonds zahlt an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Monatsende, und zwar für jedes von der Verwaltungsstelle verwaltete Portfolio und mit den folgenden Sätzen:

Vermögenswerte von 0 – 25.000 Mio. US\$	0,008 %
Vermögenswerte über 25.000 Mio. US\$	0,005 %

Die oben genannten Gebühren unterliegen einer monatlichen Mindestgebühr von 4.000 US\$ pro Portfolio und umfassen vier Anteilklassen pro Portfolio. Bei Portfolios, die mehr als vier Anteilklassen haben, wird für jede zusätzliche Anteilklasse eine monatliche Gebühr von 150 US\$ erhoben.

Darüber hinaus hat die Verwaltungsstelle Anspruch auf eine weitere Gebühr in Bezug auf die Transferstellendienste, die sie für das Portfolio erbringt.

In Bezug auf Anteile der Klassen B, C, E, C1 und C2 des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz von 1,00 % des NIW der betreffenden Klassen. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. In Bezug auf Anteile der Klasse M des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für seine/ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz in Höhe eines Prozentsatzes des NIW der jeweiligen Klasse. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. Der Satz für diese Vertriebsgebühr variiert zwischen den Portfolios und ist im Nachtrag für die einzelnen Portfolios aufgeführt. In Bezug auf alle anderen Klassen kann der Manager der Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienste eine Gebühr (zu normalen kommerziellen Sätzen) zahlen, die ebenfalls durch Managementgebühr abgedeckt wird.

**Gebühren der nicht verbundenen Unterberater**

Die an die vom Manager und/oder Sub-Investment-Manager ernannten nicht verbundenen Unterberater gezahlten Gebühren werden mit Ausnahme der Green Court Capital Management Limited aus dem Portfoliovermögen bestritten. Die insgesamt an alle Berater gezahlten Gebühren lagen zwischen 0,65 % und 1,50 % des NIW des Portfolios. Die aggregierten Beratungsgebühren für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 betragen 1.622.785 US\$ (31. Dezember 2021: 362.032 US\$).

**Erfolgsabhängige Gebühren**

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 wird eine erfolgsabhängige Gebühr für den US Long Short Equity, den Global High Yield SDG Engagement, den Event Driven, den Uncorrelated Strategies und den XXXXXXXXXXXX berechnet.

**An den Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr (die „erfolgsabhängige Gebühr“), die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr. Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer Anteilklasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des unten für jedes Portfolio definierten Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und Anteilinhabern somit eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Wird der Managementvertrag vor Ende des Berechnungszeitraums in einem beliebigen Jahr beendet, dann wird die erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum so berechnet und ausbezahlt, als ob das Datum, zu dem dieser Vertrag beendet wird, dem Ende des betreffenden Berechnungszeitraums entspräche.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr verwendete Methode für jedes betreffenden Portfolio gestaltet sich wie folgt:

**US Long Short Equity**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

Berechnungszeitraum	<p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p>
Festlegung (Kristallisierung)	<p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>
High Water Mark (Höchstmarke)	<p>Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.</p>

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im NIW je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt. Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des NIW je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Eine erfolgsabhängige Gebühr wird erst gezahlt, wenn der NIW je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die Hurdle Rate (Mindestrendite) hinausgehenden NIW je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**US Long Short Equity (Fortsetzung)**Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von null USD (31. Dezember 2021: 355.899 US\$).

**Global High Yield SDG Engagement**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

Benchmark	ICE BofA Global High Yield Constrained Index in der entsprechenden Klassenwährung (wie nachstehend beschrieben)
Berechnungszeitraum	<p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p>
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine nicht ausgleichende erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umwandelt.
Outperformance	Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des NIW je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)**

Methode (Fortsetzung)

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse bei einer Outperformance, d. h. einer überdurchschnittlich positiven Entwicklung des NIW je Anteil gegenüber der Performance der für diese spezielle PF-Klasse im Berechnungszeitraum geltenden Benchmark, fällig. Die prozentuale Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 20 % der für diese spezielle PF-Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Für den Fall, dass die Performance einer PF-Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese PF-Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die PF-Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese PF-Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der NIW je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmark-Wert für den nächsten Berechnungszeitraum dem NIW in Bezug auf die PF-Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h., wenn der NIW 110 entsprechen würde, läge der Benchmark-Wert ebenfalls bei 110.

Benchmarkindizes

Klassen	Index	Code
USD PF-Klassen:	ICE BofA Global High Yield Constrained Index	HWOC ausgewählte Währung USD
Abgesicherte PF-Klassen EUR	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in EUR abgesichert	HWOC ausgewählte Währung EUR
Abgesicherte PF-Klassen GBP	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in GBP abgesichert	HWOC ausgewählte Währung GBP

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der NIW ihrer Anteile zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende eines Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Manager gezahlt.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Event Driven**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

Berechnungszeitraum	<p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p>
Festlegung (Kristallisierung)	<p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>
High Water Mark (Höchstmarke)	<p>Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.</p>

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, mit Ausnahme der Klassen I5, für die die erfolgsabhängige Gebühr 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, entspricht.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des Nettoinventarwerts je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten Nettoinventarwert je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Es wird keine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt, wenn der Nettoinventarwert je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die High Water Mark hinausgehenden Nettoinventarwerts je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Event Driven (Fortsetzung)**

Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im Nettoinventarwert auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 89.185 US\$.

*An die Berater gezahlte erfolgsabhängige Gebühr*

**Uncorrelated Strategies**

Die vom Sub-Investment-Manager ernannten Berater („nicht verbundene Unter-Berater“) haben unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr (die „erfolgsabhängige Gebühr des Beraters“), die aus dem Portfoliovermögen zahlbar ist und nachstehend ausführlicher beschrieben wird. Zur Vermeidung von Zweifeln werden jedoch keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager oder an ein mit dem Sub-Investment-Manager verbundenes Unternehmen, das vom Sub-Investment-Manager als Berater bestellt wurde, (ein „interner Berater“) auf irgendeinen Teil der Vermögenswerte des Portfolios ausgezahlt, das vom Sub-Investment-Manager oder einem internen Berater verwaltet wird, der als Berater handelt. Alle Anteilklassen im Portfolio sind PF-Klassen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

## Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An die Berater gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

## Definitionen

Zugewilterter Anteil	Der Teil des Portfolios, für den ein nicht verbundener Unterberater verantwortlich ist.
Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: <ul style="list-style-type: none"> <li>im Fall der erstmaligen Bestellung eines nicht verbundenen Unterberaters, der Berechnungszeitraum vom Datum der Bestellung bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>im Fall der Kündigung eines nicht verbundenen Unterberaters, der Berechnungszeitraum am Datum der Kündigung endet; und</li> <li>im Fall der Auflösung des Sub-Investment-Management-Vertrags während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul>
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr des Beraters an den nicht verbundenen Unterberater zahlbar wird. Eine Festlegung in Bezug auf einen nicht verbundenen Unterberater erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) aufgrund des vom Sub-Investment-Manager reduzierten Kapitals, das dem jeweils zugewitterten Anteil zugeordnet ist, oder (iii) aufgrund der Kündigung der Bestellung dieses externen Beraters.
High Water Mark (Höchstmarke)	In Bezug auf einen nicht verbundenen Unterberater der höhere Wert entweder: (i) des NIW seines zugewitterten Anteils bei seiner Bestellung, oder (ii) des Werts, den dieser zugewitterte Anteil am Ende eines vorherigen Berechnungszeitraums erzielt hatte, für den eine erfolgsabhängige Gebühr des Beraters gezahlt wurde, angepasst für den zugewitterten Anteil betreffende Zeichnungen und/oder Rücknahmen.

## Methode

Eine erfolgsabhängige Gebühr des Beraters ist an einen nicht verbundenen Unterberater nur für den betreffenden zugewitterten Anteil zahlbar, und nur ab dem Zeitpunkt, ab dem der Sub-Investment-Manager den nicht verbundenen Unterberater zur Verwaltung des zugewitterten Anteils ernannt hat, gegebenenfalls bis zu dem Zeitpunkt, an dem der nicht verbundene Unterberater den zugewitterten Anteil nicht mehr verwaltet.

Für jeden Berechnungszeitraum, in dem der Nettoinventarwert des zugewitterten Anteils die High Water Mark übersteigt, entspricht die zahlbare erfolgsabhängige Gebühr des Beraters dem Anstieg des Nettoinventarwerts des dem externen Berater zugewitterten Anteils über die High Water Mark, multipliziert mit dem für die erfolgsabhängige Gebühr des nicht verbundenen Unterberaters festgelegten Satz, wie mit dem Sub-Investment-Manager vereinbart, der 20 % nicht übersteigen darf.

Die erfolgsabhängige Gebühr des Beraters wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr des Beraters wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert des jeweiligen zugewitterten Anteils berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Portfolioaufwendungen (mit Ausnahme von Managementgebühren) werden anteilig auf jeden zugewitterten Anteil und auf den Anteil der Vermögenswerte des Portfolios umgelegt, die nicht einem nicht verbundenen Unterberater zugewittert sind, und die erfolgsabhängige Gebühr des Beraters in Bezug auf jeden zugewitterten Anteil wird nach Abzug des Anteils dieser Aufwendungen, die dem jeweils zugewitterten Anteil zuzuordnen sind, berechnet und gezahlt.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An die Berater gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

**Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)**

Methode (Fortsetzung)

Die erfolgsabhängige Gebühr des Beraters wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an einen nicht verbundenen Unterberater gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr des Beraters während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr des Beraters für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren des Beraters verbleiben im Portfolio, bis sie an den nicht verbundenen Unterberater gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des zugeteilten Anteils. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren des Beraters werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des jeweils zugeteilten Anteils, des Portfolios oder des Fonds (außer den an den nicht verbundenen Unterberater zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt .

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr des Beraters.

Anleger sollten beachten: Da die erfolgsabhängige Gebühr des Beraters an einen nicht verbundenen Unterberater für die Wertentwicklung des ihm zugeteilten Anteils und nicht für die Wertentwicklung des gesamten Portfolios berechnet wird und zahlbar sein kann, ist es möglich, dass das Portfolio einem nicht verbundenen Unterberater eine erfolgsabhängige Gebühr zahlt, obwohl die Performance des gesamten Portfolios negativ ist. Dazu könnte es beispielsweise kommen, wenn sich der einem nicht verbundenen Unterberater zugeteilte Anteil in einem Berechnungszeitraum gut entwickelt, die den übrigen nicht verbundenen Unterberatern zugeteilten Anteile aber negativ, und die negative Performance insgesamt höher ausfällt als die positive Performance des nicht verbundenen Unterberaters, der die erfolgsabhängige Gebühr des Beraters erhält.

Erfolgsabhängige Gebühren des Beraters fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren des Beraters auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Nicht verbundene Unterberater können vom Portfolio Research-Aufwendungen durch die Bereitstellung eines jährlichen, mit dem Fonds vereinbarten Research-Budgets für das Portfolio erheben.

Die von nicht verbundenen Unterberatern erhältlichen erfolgsabhängigen Gebühren in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 werden nachstehend aufgeführt.

	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$
AllianceBernstein L.P	-	3.439.239
Alcova Asset Management LLP	-	1.817.958
Altiq LLP	21.317.397	234.718
BH-DG Systematic Trading LLP	15.047.058	-
Cabel Capital Management LLC	4.457.671	1.895.626
P/E Global LLC	13.075.361	3.341.942
Portman Square Capital	12.616.619	39.956
Sandbar Asset Management LLP	121.822	-
Soloda Investment Advisors LLP	9.242.199	6.111.664

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

## Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr

XXXXXXXXXXXX

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen und wie genauer unten beschrieben zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

## Definitionen

Benchmark	ICE BofA 1- Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index in der entsprechenden Klassenwährung. Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.
Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstaussgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul>
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.
Outperformance	Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.

## Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

XXXXXXXXXXXX (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 verdiente der Sub-Investment-Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 1.351 US\$.

Gebühren der Verwahrstelle

Die Gesellschaft bezahlt der Verwahrstelle eine Gebühr für Treuhanddienstleistungen für jedes Portfolio die maximal 0,02 % pro Jahr des NIW des jeweiligen Portfolios beträgt und monatlich anfällt und monatlich rückwirkend zahlbar ist. Die Verwahrstelle hat auch Anspruch auf Erstattung von dem Fonds aus dem Portfoliosvermögen von Verwahrgebühren, Transaktionsgebühren und angemessenen Auslagen („Depotbankgebühren“), die zugunsten des Portfolios entstehen, einschließlich der Gebühren (die normale kommerzielle Sätze nicht übersteigen werden) und angemessener Auslagen von Unter-Depotbanken, die von der Verwahrstelle beauftragt werden.

Die aggregierten Beträge, die der Gesellschaft im Laufe des Geschäftsjahres für Management, Vertrieb, Verwaltung, Verwahrleistungen und Performance entstanden sind bzw. auf die sie verzichtet hat, sind nachstehend aufgeführt.

	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Managementgebühr	220.981.106	268.553.811
Vertriebsgebühren	11.861.633	16.396.274
Verwaltungsgebühren	21.323.731	26.257.740
Depotgebühren	3.500.933	4.788.950
Gebühren der Verwahrstelle	1.640.283	1.792.081
Erfolgsabhängige Gebühr	75.968.663	17.237.002
Verzicht auf Managementgebühren	(2.876.095)	(3.873.775)
Verzicht auf Gebühren	(227.107)	(270.977)

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****7. HONORARE UND AUFWENDUNGEN DER DIREKTOREN**

Die Direktoren haben als Vergütung für ihre Dienste Anspruch auf ein Honorar, dessen Höhe von Zeit zu Zeit von den Direktoren festgelegt wird, wobei der an einen Direktor jährlich in Bezug auf den Fonds zu zahlende Betrag der Vergütung 75.000 € (oder 85.000 € im Falle eines Vorsitzenden des Fonds) oder einen anderen Betrag, den die Direktoren jeweils ggf. festlegen, nicht überschreiten wird. Die Direktoren sowie diese ggf. vertretende Direktoren haben Anspruch auf die Erstattung sämtlicher angemessenen Reise-, Hotel- und anderen Kosten, die ihnen bei der Teilnahme an Sitzungen der Direktoren oder der Anteilinhaber oder anderen Versammlungen im Zusammenhang mit dem Geschäftsbetrieb des Fonds entstehen. Sämtliche auf die Honorare der Direktoren gezahlten Lohnsteuern sind in den Gesamtkosten enthalten. Keiner der Direktoren hat einen Dienstvertrag mit dem Fonds abgeschlossen, derartige Verträge sind auch nicht vorgesehen, und kein Direktor ist in der Unternehmensleitung des Fonds tätig. Die Direktoren, die zugleich Mitarbeiter von Neuberger Berman Europe Limited sind, erhalten für ihre Dienstleistungen als Direktoren der Gesellschaft kein Honorar.

Die Gesamtbezüge der Direktoren (einschließlich Spesen) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 betragen insgesamt 259.448 US\$ (31. Dezember 2021: 270.968 US\$), von denen 60.237 US\$ am Jahresende noch ausstanden (31. Dezember 2021: 44.967 US\$).

Zum 31. Dezember 2022 waren Michelle Green und Alex Duncan Direktoren und ebenfalls bei der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“), dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green zudem eine Direktorin der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“), dem Manager des Fonds. Michelle Green und Alex Duncan haben sich freiwillig bereit erklärt auf ihren Anspruch auf eine Vergütung in Hinblick auf ihre Pflichten als Direktoren für das zum 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr zu verzichten (31. Dezember 2021: ebenso).

Die Honorare der Direktoren werden vor Abzug der Einkommensteuer ausgewiesen. Von den Direktoren wurden keine Sachleistungen bezogen.

**8. VERGÜTUNG DER ABSCHLUSSPRÜFER**

Ernst & Young, Chartered Accountants haben für ihre im Geschäftsjahr geleistete Arbeit für den Fonds folgende Vergütung (ohne MwSt.) erhalten:

	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$
Gesetzliches Prüfungshonorar: - Ernst & Young (Irland):	482.682	539.137
Sonstige Honorare ohne Prüfungshonorare: - Ernst & Young (Österreich):	141.982	153
- Ernst & Young (Schweiz):	126.681	166.417

**9. SONSTIGE GEBÜHREN UND KOSTEN**

Die Transaktionskosten sind die beim Kauf, bei der Emission oder beim Verkauf von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anfallenden Kosten. Zu den Transaktionskosten gehören Gebühren und Provisionen für Makler und Händler, die an Aufsichtsbehörden und Börsen zahlbaren Gebühren und bei der Übertragung fällig werdenden Steuern und Abgaben. Die Transaktionskosten erstrecken sich nicht auf Auf- oder Abschläge auf Fremdkapitalanlagen, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- bzw. Haltekosten. Diese Kosten werden verbucht, sobald sie anfallen und für die Zwecke der Finanzberichterstattung in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst.

Der Fonds und die Portfolios zahlen auch bestimmte sonstige Kosten, Gebühren, Honorare und Aufwendungen, die im Rahmen ihres Betriebs entstehen. Diese können insbesondere Gebühren und Kosten enthalten, die im Zusammenhang mit Bank- und Maklerdienstleistungen beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren der Portfolios entstehen, Steuern, Versicherungen, die Kosten und Aufwendungen für die Buchführung und die Abfassung, den Druck, die Veröffentlichung und Verteilung der Verkaufsprospekte, Nachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und sonstiger Dokumente und Informationen (in den jeweils notwendigen Sprachen) für bestehende oder potenzielle Anteilinhaber (einschließlich der Kosten für die Entwicklung und Verbesserung von Software und elektronischen Übertragungstechniken zur Verteilung dieser Dokumente oder Informationen), die Kosten für die Veröffentlichung von Preis- und Renditeinformationen in den relevanten Medien, die Kosten und Aufwendungen für das Einholen von Genehmigungen oder Registrierungen der Gesellschaft oder von Anteilen bei den Aufsichtsbehörden verschiedener Rechtsordnungen, einschließlich etwaiger von der Central Bank of Ireland erhobener Abgaben, die Kosten für die Notierung und Aufrechterhaltung der Notierung von Anteilen an einer Börse, Marketing- und Werbekosten, die Kosten für die Einberufung und Abhaltung der Versammlungen der Direktoren und der Anteilinhaber, die Kosten für die Ausübung der Stimmrechte im Zusammenhang mit der Anlage der Gesellschaft im besten Interesse der Anteilinhaber und die Honorare und Aufwendungen für Rechts-, Rechnungsprüfungs- und andere Beratungsleistungen, sämtliche Kosten, die durch die Auflösung oder Liquidierung der Gesellschaft entstehen, sowie alle weiteren Kosten und Aufwendungen (einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen eingeschlossen), die von Zeit zu Zeit entstehen und von den Direktoren als notwendig oder angemessen für den fortdauernden Geschäftsbetrieb der Gesellschaft oder eines Portfolios genehmigt wurden. Im Zusammenhang mit der Registrierung des Fonds oder der Anteile zum Verkauf in bestimmten Rechtsordnungen zahlt der Fonds die Gebühren und Kosten von Zahl- und Informationsstellen und/oder Korrespondenzbanken. Diese Zahlungen erfolgen zu marktüblichen Sätzen.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**9. SONSTIGE GEBÜHREN UND KOSTEN (FORTSETZUNG)**

Der Manager begleicht alle Kosten für von ihm bezogenes Research direkt, ungeachtet der Bezugsquelle. Sub-Investment-Manager mit Sitz außerhalb der EU, die bezogenes Research nicht in die EU weiterleiten, können dem betreffenden Portfolio durch Bereitstellung eines jährlichen Research-Budgets für jedes Portfolio Research-Kosten in Rechnung stellen.

Für die Zwecke des Jahresabschlusses werden Gründungsaufwendungen in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst. Für die Berechnung des NIW pro Anteil Aktie für Handelszwecke der Anteilinhaber werden Gründungsaufwendungen über die ersten zwei Jahre der Laufzeit des Portfolios abgeschrieben.

**10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN**

Gemäß FRS 102 „Transaktionen mit nahe stehenden Parteien“ gelten Parteien als nahe stehend, wenn eine Partei die Möglichkeit hat, die Kontrolle über die andere Partei auszuüben oder bei finanziellen oder betrieblichen Entscheidungen entscheidenden Einfluss auf die andere Partei auszuüben.

Frau Michelle Green und Herr Alex Duncan sind Direktoren der Gesellschaft sowie Direktoren und Mitarbeiter von NBEL, der Manager (bis 30. Juni 2021), Promoter (bis 30. Juni 2021), Sub-Investment-Manager (seit 1. Juli 2021) und die Vertriebsstelle der Gesellschaft. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green auch Direktorin von NBAMIL, der Manager (seit 1. Juli 2021) der Gesellschaft. Die von NBEL und NBAMIL in den Jahren zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 erhältlichen Gebühren sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Nähere Angaben zu den in den zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 gezahlten Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

Managementgebühren und erfolgsabhängige Gebühren *	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Von NBEL erhältliche Managementgebühren	-	130.109.622
Von NBAMIL erhältliche Managementgebühren	220.981.106	138.444.189
An NBAMIL ausstehende Managementgebühren	18.121.204	22.909.509
Von NBEL erhältliche erfolgsabhängige Gebühren	-	-
Von NBAMIL erhältliche erfolgsabhängige Gebühren	89.185	355.899
An NBAMIL ausstehende erfolgsabhängige Gebühren	89.185	355.899

\*Weitere Informationen zu den Managementgebühren und erfolgsabhängigen Gebühren finden sich in Anmerkung 6.

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 hielten folgende Portfolios Anteile in anderen, von mit dem Manager verbundenen Unternehmen verwaltete Portfolios:

Portfolio	Bestand*	Verwaltet von	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
			Anteile	Wert	Anteile	Wert
Corporate Hybrid Bond	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	1.300.000	10.317.170	1.300.000	11.305.839
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	150.000	16.110.000	150.000	16.683.000
Emerging Market Debt - Local Currency	China Bond	NBAMIL	1.595.000	15.136.550	1.595.000	16.157.350
Emerging Market Debt Blend	China Bond	NBAMIL	1.409.964	13.380.558	1.596.964	16.177.245
Global Flexible Credit Income	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBIA***	394.721	338.564	394.721	474.751
Global Opportunistic Bond	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	200.000	1.694.000	200.000	1.978.000
Global Opportunistic Bond	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBIA***	125.000	107.216	125.000	150.344
High Yield Bond	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBIA***	21.329.208	18.294.706	25.312.164	30.444.245
Multi-Asset Income	China Bond	NBAMIL	40.890	388.047	79.779	808.161
Multi-Asset Income	Commodities	NBAMIL	16.300	184.515	-	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Bestand*	Verwaltet von	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
			Anteile	Wert	Anteile	Wert
Short Duration Emerging Market Debt	Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	655.000	70.347.000	655.000	72.849.100
Short Duration High Yield SDG Engagement	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBIA***	1.423.570	1.221.039	-	-
Strategic Income	China Bond	NBAMIL	1.208.113	11.815.344	1.208.113	13.603.351
Strategic Income	Euro Bond Absolute Return	NBAMIL	945.691	10.270.208	945.691	10.506.631
Strategic Income	European High Yield Bond	NBAMIL	486.855	5.477.118	486.855	5.886.076
Strategic Income	Global Flexible Credit Income	NBAMIL	459.982	4.921.803	459.982	5.432.382
Strategic Income	Global High Yield SDG Engagement	NBAMIL	654.438	8.062.679	654.438	9.024.704
Strategic Income	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	2.000.000	16.940.000	2.000.000	19.780.000
Strategic Income	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBIA***	861.209	738.685	861.209	1.035.820

\*Zum 31. Dezember 2022 (ggf. 31. Dezember 2021) betrug die effektive Managementgebühr nach Ermäßigung(en) für jede der oben genannten Bestände in jedem Portfolio 0,00 %.

\*\* Die Managementgebühr für den NB Global Monthly Income Fund Ltd beträgt 0,75 %.

\*\*\* Neuberger Berman Investment Advisers LLC.

Der Manager gewährte den auf der Vorseite genannten Portfolios im Zusammenhang mit ihren Anlagen einen Rabatt, so dass ihre effektiven Managementgebührensätze für die Anlagen 0,00 % betragen (31. Dezember 2021: gleich). Der von jedem Portfolio gewährte Gebührenverzicht wird unter „Verzicht auf Beratungsgebühren“ in den Gewinn- und Verlustrechnungen ausgewiesen.

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 wurden die Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios der Gesellschaft vom konsolidierten Abschluss ausgeschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Den Direktoren sind mit Ausnahme der in diesem Jahresabschluss angegebenen keine Transaktionen mit nahe stehenden Parteien im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 bekannt (31. Dezember 2021: ebenso).

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 hatten die folgenden Anteilinhaber, die als nahe stehende Parteien galten, folgende Anlagen im Fonds getätigt.

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2021 Anzahl der Anteile
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	923
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.871	1.871
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse EUR I5	Mitarbeiter von Neuberger Berman	1.965	1.965
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	923
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.326	2.326
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	500	500
5G Connectivity	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	552	552
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD I5	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.953	11.362
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	112.195	87.653
Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.046	1.046
Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.162.791	-
Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	-	947.710
Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD I4	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.193	1.000
Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Group LLC	848.201	-
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse CNY I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	688	688

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse CNY I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	774	774
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	1.000
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Mitarbeiter von Neuberger Berman	1.934	-
China A-Share Equity	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	250.091	250.091
China Bond	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.993	1.993
China Bond	Ausschüttende Klasse CNY I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.347	-
China Bond	Ausschüttende Klasse CNY I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	704
China Bond	Thesaurierende Klasse CNY Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	1.218	1.218
China Bond	Thesaurierende Klasse CNY Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	614	614
China Bond	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	3.000
China Bond	Thesaurierende Klasse GBP I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.176	2.176
China Bond	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.003	1.003
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Emerging Market Debt - Local Currency	1.595.000	1.595.000
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Emerging Market Debt Blend	1.409.964	1.596.964
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Multi-Asset Income	40.890	79.779
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	40.000	40.000
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	Mitarbeiter von Neuberger Berman	7.283	11.850
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	Strategic Income	1.208.113	1.208.113
China Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	891	891
China Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	16.177	16.177
CLO Income	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.824	-
CLO Income	Ausschüttende Klasse GBP I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.780
CLO Income	Thesaurierende Klasse GBP Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.285
CLO Income	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.144	-



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
CLO Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	42.619	42.619
Commodities <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	806	-
Commodities <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse GBP I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.290	-
Commodities <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	1.431	-
Commodities <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Multi-Asset Income	16.300	-
Commodities <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Commodities <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.284	-
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.390	1.390
Corporate Hybrid Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.000	-
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse EUR I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.462	2.462
Corporate Hybrid Bond	Thesaurierende Klasse GBP I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	973	-
Corporate Hybrid Bond	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.469
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse USD I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.128	1.128
Corporate Hybrid Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	33.729	16.722
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse CHF I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.911	2.911
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse CHF P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.118	1.118
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.008	1.008
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse EUR P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	946	946
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	36.062	36.062
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	978	978

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilkategorie	Anteilinhaber	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2021 Anzahl der Anteile
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.990
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.752	9.752
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse AUD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	824	824
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse AUD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.494	1.494
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.472	1.472
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	14.328	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse GBP I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	7.903	7.903
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.011	1.011
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse SEK A	Mitarbeiter von Neuberger Berman	11.535	11.535
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse USD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse USD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Emerging Market Debt - Local Currency	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust	5.097.097	7.668.272
Emerging Market Debt - Local Currency	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Global Strategic Income	192.560	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse USD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	950	950
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse ZAR E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	855	855
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.683	1.683
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.000	3.000
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.487	9.487
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	746	746

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2021 Anzahl der Anteile
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	746	746
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.315
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	772	772
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse NOK U	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.286	2.286
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	699	699
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.025	1.025
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	9	9
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse USD I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	857
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.460	10.646
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse NOK I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	808	808
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	250.117
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	81	81
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	250.358	-
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse AUD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.356	1.356
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse AUD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.356	1.356
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.662	2.662
Emerging Markets Equity	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	8.283	8.283
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	901	901
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	22.279	22.279
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	800	800
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse USD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	670	670
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	24.884	24.884
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse ZAR B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.410	1.410
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse ZAR E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.410	1.410

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilkategorie	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.765	2.765
Emerging Markets Select Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	814	814
Emerging Markets Sustainable Equity	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.882
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	30.000
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	28.155	28.155
Euro Bond Absolute Return	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	219.027
Euro Bond Absolute Return	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	930	-
Euro Bond Absolute Return	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.158.459
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	247.390	-
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.146.064	-
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	945.691	945.691
Euro Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.000	3.000
Euro Opportunistic Bond	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	978.926	978.926
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.947	1.947
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse EUR X	Mitarbeiter von Neuberger Berman	4.413	-
European High Yield Bond	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.630	1.630
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	373.413
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	654.450
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.639	3.639
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	472.326	-
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	386	386
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	827.807	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilkategorie	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	486.855	486.855
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.627	-
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	825	825
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	409.879
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.027	-
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Group LLC	-	3.134.300
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.593	2.593
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.649	1.649
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	408.530	-
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	32.029	22.014
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR Z	Neuberger Berman Group LLC	3.124.536	-
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	1.970.793	1.970.793
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Event Driven <sup>1</sup>	Ausschüttende Klasse GBP I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	-
Event Driven <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	-
Event Driven <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	1.000.000	-
Event Driven <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Global Bond	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.937	3.936
Global Bond	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Global Bond	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	888	888
Global Bond	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilkategorie	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
Global Bond	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.481	4.481
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.009	1.009
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD C1	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	8.678	-
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.359	2.359
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Global Flexible Credit Income	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	7.763	7.763
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD Z	High Yield Bond	-	459.982
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	22.231	8.053
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	459.982	459.982
Global High Yield SDG Engagement	Ausschüttende Klasse AUD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	4.223	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse CHF I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.931	-
Global High Yield SDG Engagement	Ausschüttende Klasse CHF I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.931	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse CHF X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.931	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.846	-
Global High Yield SDG Engagement	Ausschüttende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.846	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse EUR X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.846	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse GBP I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.398	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilkategorie	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse GBP X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.398	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.796	942
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	816	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	-
Global High Yield SDG Engagement	Ausschüttende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.013	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	2.226	2.226
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	789	-
Global High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	654.438	654.438
Global High Yield Sustainable Action	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global High Yield Sustainable Action	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.458.132	1.458.132
Global High Yield Sustainable Action	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Corporate Hybrid Bond	1.300.000	1.300.000
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Global Opportunistic Bond	200.000	200.000
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.498.000	1.498.000
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	2.000.000	2.000.000
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.295	2.295
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.175	1.175
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	669	669
Global Opportunistic Bond	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.083	1.083

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	-	6.813
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.210	8.510
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	500	200
Global Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.315	3.315
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.811	9.811
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.649	1.649
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	Mitarbeiter von Neuberger Berman	122.222	124.559
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	722	722
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	722	722
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	1.000
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.518	9.668
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	497.000
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.131	-
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	-	2.333.918
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	528.063	-
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	160	-
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Group LLC	2.481.151	-
High Yield Bond	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.675	1.675
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	15.211	15.211
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	6.162	100



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
High Yield Bond	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust	5.674.132	7.609.791
High Yield Bond	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Global Strategic Income	483.669	-
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	11.486
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	1.208
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	28.793	26.667
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.308	1.308
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse CHF I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.747	2.747
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	2.539
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	2.539
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	2.584
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	2.539
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse SGD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.031	2.031
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse SGD I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.031	2.031
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse SGD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.031	2.031
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	476.000	476.000
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I4	Mitarbeiter von Neuberger Berman	2.037	2.037
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.242	2.242
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	3.576	3.576

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
Japan Equity Engagement	Ausschüttende Klasse JPY I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	497.000	497.000
Japan Equity Engagement	Ausschüttende Klasse JPY I	Neuberger Berman Group LLC	-	2.983.942
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	318	318
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	140.482	127.221
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY Z	Neuberger Berman Group LLC	4.692.912	-
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	1.000
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	23.771	23.771
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.749
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	16.762	16.762
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse SEK I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.830	2.830
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.081	1.081
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	7.959	7.959
Multi-Asset Income	Ausschüttende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.332	2.332
Multi-Asset Income	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	847	847
Multi-Asset Income	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	2.917	2.917
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.459	2.459
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.632	2.632
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD C1	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	738	100
Next Generation Mobility	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	730	730
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD X	Mitarbeiter von Neuberger Berman	588	588
Next Generation Space Economy <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	94.928	-
Next Generation Space Economy <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	94.928	-
Next Generation Space Economy <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	300.000	-
Short Duration Emerging Market Debt	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.365	1.365
Short Duration Emerging Market Debt	Ausschüttende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	814	814
Short Duration Emerging Market Debt	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.487	2.487
Short Duration Emerging Market Debt	Thesaurierende Klasse SEK A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.374	2.374
Short Duration Emerging Market Debt	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	3.034
Short Duration Emerging Market Debt	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	28.808	28.808
Short Duration High Yield SDG Engagement	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	23.546	-
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	839	-
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	32.263	27.991
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	6.782	-
Strategic Income	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.861	-
Strategic Income	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	7.239	-
Strategic Income	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	834	834
Strategic Income	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	11.473	11.473
Strategic Income	Thesaurierende Klasse SGD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	682	682
Strategic Income	Ausschüttende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.093	1.093
Strategic Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	24.029	24.029
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Group LLC	1.000	1.000
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Group LLC	1.000	1.000
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.225	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2021 Anzahl der Anteile
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	-	2.498.000
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	13.395	-
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Group LLC	2.395.262	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Thesaurierende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	787	787
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Thesaurierende Klasse SEK A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.409	2.409
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.040	1.040
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Systematic Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	927	-
Systematic Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	886	886
Systematic Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	613	613
Systematic Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	3.166	2.658
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse CHF U	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	294	294
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	247	247
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	122	122
Ultra Short Term Euro Bond	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	119	119
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	88
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	252	252
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR U	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	79	79
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR Z	Direct Private Equity	-	584.257
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	22.356	13.241
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Emerging Market Debt - Hard Currency	150.000	150.000
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Short Duration Emerging Market Debt	655.000	655.000
Uncorrelated Strategies	Thesaurierende Klasse EUR P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.931	-
Uncorrelated Strategies	Ausschüttende Klasse GBP I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	858	-
Uncorrelated Strategies	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	21.992	21.179
Uncorrelated Strategies	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	16.007	18.240

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2021 Anzahl der Anteile
US Equity	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
US Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	415	-
US Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	997	997
US Equity	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	229.104	229.104
US Equity	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.132	2.132
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.655	2.655
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.111	1.111
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.143	1.143
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	941	941
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse GBP I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.120	2.120
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse GBP I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.156
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse GBP I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	846
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse GBP I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	787
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.187	2.187
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	809	809
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	759	759
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse USD I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	849
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse USD I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.134	1.134
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	117.446	95.197
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.066	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	947	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.688	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse GBP I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.528	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	843	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2021 Anzahl der Anteile
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse GBP I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.528	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	843	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	797	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.678	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	797	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	858	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	8.044	-
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	4.524	200.000
US Large Cap Value <sup>2</sup>	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	1.016	-
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.771	2.771
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.771
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.455
US Long Short Equity	Ausschüttende Klasse GBP I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.302	2.302
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse USD I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.115	1.115
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	13.363	13.363
US Multi Cap Opportunities	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	516	516
US Multi Cap Opportunities	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.065	1.065
US Multi Cap Opportunities	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	12.942	11.728
US Multi Cap Opportunities	Ausschüttende Klasse USD1 I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	268	268
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.418	1.418

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
			Anzahl der Anteile	Anzahl der Anteile
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.586	1.586
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.424	1.424
US Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.140	1.140
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	943	943
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.008	1.008
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	985	985
US Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	15.008	14.727
US Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.921	2.921
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.790	1.790
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	1.208
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	727	727
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD C2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.010	1.010
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	756	756
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.329	1.329
US Small Cap	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.531	2.531
US Small Cap	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	18.894	18.639
US Small Cap	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	10.663	10.663
US Small Cap	Thesaurierende Klasse ZAR E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	745	745
US Small Cap	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.812	1.812
US Small Cap Intrinsic Value	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.160
US Small Cap Intrinsic Value	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
US Small Cap Intrinsic Value	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	958	958

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen

	5G Connectivity		Absolute Return Multi Strategy*	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(480.089.945)	93.138.985	(3.129)	2.105.872
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(53.103.108)	(9.043.745)	(4.362)	2.213
	(533.193.053)	84.095.240	(7.491)	2.108.085
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(412.983.630)	16.764.943	(13.114)	(4.482.123)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	4.336.986	(14.960.500)	20	(103.000)
	(408.646.644)	1.804.443	(13.094)	(4.585.123)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(941.839.697)	85.899.683	(20.585)	(2.477.038)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Asian Debt - Hard Currency		China A-Share Equity	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	CNY	CNY
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(550.962)	110.992	(2.051.051)	1.373.381
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(14)	(1.222)	131.494	(12.824)
	(550.976)	109.770	(1.919.557)	1.360.557
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(1.370.732)	(886.143)	(3.907.067)	(1.632.727)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	30.608	(7.327)	115.492	(43.437)
	(1.340.124)	(893.470)	(3.791.575)	(1.676.164)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(1.891.100)	(783.700)	(5.711.132)	(315.607)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	China Bond		China Equity	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	CNY	CNY	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(47.859.261)	(27.718.464)	(30.904.361)	48.832.818
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	6.533.634	(10.245.998)	(5.247.061)	6.188.242
	(41.325.627)	(37.964.462)	(36.151.422)	55.021.060
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	19.316.084	(14.440.494)	(70.415.570)	(81.716.434)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(878.279)	8.050.831	(12.256.852)	(4.199.054)
	18.437.805	(6.389.663)	(82.672.422)	(85.915.488)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(22.887.822)	(44.354.125)	(118.823.844)	(30.894.428)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	CLO Income		Commodities <sup>1</sup>
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022
	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(9.982.934)	2.687.012	(3.361.701)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	91.107	85.022	536
	(9.891.827)	2.772.034	(3.361.165)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(16.598.419)	(1.350.187)	1.346.623
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(559.978)	(127.032)	1
	(17.158.397)	(1.477.219)	1.346.624
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(27.050.224)	1.294.815	(2.014.541)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Corporate Hybrid Bond		Diversified Currency*	Emerging Market Debt - Hard Currency	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	EUR	EUR	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>					
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(102.874.764)	(1.535.983)	17.499	(264.197.117)	(63.504.556)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	33.878.891	(4.047.511)	1	(13.182.862)	7.332.766
	(68.995.873)	(5.583.494)	17.500	(277.379.979)	(56.171.790)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(266.900.364)	(58.477.981)	(14.828)	(608.219.340)	(335.974.595)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(26.066.929)	61.319.538	(29)	(21.966.897)	(49.429.999)
	(292.967.293)	2.841.557	(14.857)	(630.186.237)	(385.404.594)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(361.963.166)	(2.741.937)	2.643	(907.566.216)	(441.576.384)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt - Local Currency		Emerging Market Debt Blend	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(242.882.245)	(451.783)	(124.176.650)	(6.899.928)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(72.390.918)	(36.494.503)	(19.792.555)	(9.849.848)
	(315.273.163)	(36.946.286)	(143.969.205)	(16.749.776)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(31.142.315)	(252.954.566)	(47.239.064)	(115.469.959)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(15.633.154)	(76.436.170)	(3.085.882)	(19.387.766)
	(46.775.469)	(329.390.736)	(50.324.946)	(134.857.725)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	<b>(362.048.632)</b>	<b>(366.337.022)</b>	<b>(194.294.151)</b>	<b>(151.607.501)</b>

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Diversified Currency wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend		Emerging Markets Equity	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(3.582.513)	(1.845.247)	(35.683.852)	52.735.795
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(727.107)	(45.792)	(12.336.247)	(663.977)
	(4.309.620)	(1.891.039)	(48.020.099)	52.071.818
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(5.437.577)	(494.815)	(50.571.556)	(67.415.020)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(542.245)	(794.169)	(5.958.508)	(7.994.296)
	(5.979.822)	(1.288.984)	(56.530.064)	(75.409.316)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(10.289.442)	(3.180.023)	(104.550.163)	(23.337.498)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Emerging Markets Select Equity		Euro Bond Absolute Return	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	EUR	EUR
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(8.758.509)	13.874.908	1.175.597	1.886.794
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(1.851.322)	(74.911)	80.644	66.810
	(10.609.831)	13.799.997	1.256.241	1.953.604
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(18.041.369)	(17.549.760)	(3.934.536)	(191.243)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(2.488.298)	(2.228.381)	(10.940)	48.000
	(20.529.667)	(19.778.141)	(3.945.476)	(143.243)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(31.139.498)	(5.978.144)	(2.689.235)	1.810.361

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Euro Opportunistic Bond		European High Yield Bond	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(694.978)	351.040	3.427.555	1.723.172
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	34	5	65.204	125.946
	(694.944)	351.045	3.492.759	1.849.118
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(1.278.924)	(425.016)	(5.455.410)	241.026
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	514	(684)	(363.029)	219.062
	(1.278.410)	(425.700)	(5.818.439)	460.088
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	<b>(1.973.354)</b>	<b>(74.655)</b>	<b>(2.325.680)</b>	<b>2.309.206</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	European Sustainable Equity <sup>2</sup>		Event Driven <sup>1</sup>
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022
	EUR	EUR	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(11.018.173)	1.085.422	415.203
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	478.642	43.409	(7.193)
	(10.539.531)	1.128.831	408.010
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(22.422.863)	(589.850)	1.100.016
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(1.713.109)	738.589	(16)
	(24.135.972)	148.739	1.100.000
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	<b>(34.675.503)</b>	<b>1.277.570</b>	<b>1.508.010</b>

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Bond		Global Diversified Income FMP – 2024	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(11.391.342)	2.800.274	(10.699.366)	(1.676.770)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(5.336.500)	2.944.118	(895)	(1.100)
	(16.727.842)	5.744.392	(10.700.261)	(1.677.870)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(11.585.556)	(10.657.821)	(7.559.634)	(8.366.876)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(1.484.440)	(8.696.541)	–	–
	(13.069.996)	(19.354.362)	(7.559.634)	(8.366.876)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(29.797.838)	(13.609.970)	(18.259.895)	(10.044.746)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Equity Index PutWrite*	Global Equity Megatrends	31. Dezember 2021
	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	1.803.932	525.013	1.561.134
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	11.162	(11.161)	(671)
	1.815.094	513.852	1.560.463
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(624.682)	(11.547.989)	2.635.311
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(244)	(722.336)	(22.794)
	(624.926)	(12.270.325)	2.612.517
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	1.190.168	(11.756.473)	4.172.980

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Global Equity Index PutWrite wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Flexible Credit Income		Global High Yield SDG Engagement	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(105.497.228)	56.544.519	(19.998.727)	2.640.189
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(7.159.541)	1.817.954	(2.367.879)	311.797
	(112.656.769)	58.362.473	(22.366.606)	2.951.986
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(40.182.418)	(63.432.985)	(6.198.721)	(4.645.355)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(1.097.382)	(8.409.079)	301.894	(1.104.376)
	(41.279.800)	(71.842.064)	(5.896.827)	(5.749.731)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(153.936.569)	(13.479.591)	(28.263.433)	(2.797.745)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global High Yield Sustainable Action		Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(96.461)	131.497	(602.080)	554.860
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(152.483)	101.462	(2.251.738)	(250.656)
	(248.944)	232.959	(2.853.818)	304.204
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(2.277.299)	(72.885)	(13.729.300)	(1.357.077)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(159.626)	(351.085)	(177.244)	(848.515)
	(2.436.925)	(423.970)	(13.906.544)	(2.205.592)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(2.685.869)	(191.011)	(16.760.362)	(1.901.388)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Opportunistic Bond		Global Real Estate Securities	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	1.397.209	4.361.947	(4.205.633)	582.325
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(2.680.598)	724.247	(1.518.559)	42.540
	(1.283.389)	5.086.194	(5.724.192)	624.865
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(11.185.547)	(3.541.577)	(10.322.033)	4.507.927
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(1.515.056)	(3.707.540)	(317.326)	(484.718)
	(12.700.603)	(7.249.117)	(10.639.359)	4.023.209
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(13.983.992)	(2.162.923)	(16.363.551)	4.648.074

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Sustainable Equity <sup>2</sup>		High Yield Bond	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(33.189.400)	2.913.162	(222.037.281)	197.609.007
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(5.755.843)	(205.019)	(2.727.987)	(70.613)
	(38.945.243)	2.708.143	(224.765.268)	197.538.394
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(27.981.018)	7.557.070	(274.505.380)	(252.750.018)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(1.086.634)	(690.704)	(1.339.152)	(424.536)
	(29.067.652)	6.866.366	(275.844.532)	(253.174.554)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(68.012.895)	9.574.509	(500.609.800)	(55.636.160)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	InnovAsia 5G <sup>2</sup>		Japan Equity Engagement	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	JPY	JPY
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(6.633.872)	124.738	(654.071.596)	410.243.132
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(2.189.049)	(125.282)	(259.996)	(28.088)
	(8.822.921)	(544)	(654.331.592)	410.215.044
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(3.201.743)	2.617.599	(1.085.772.594)	(619.017.346)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	56.079	(87.891)	(974.538)	–
	(3.145.664)	2.529.708	(1.086.747.132)	(619.017.346)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(11.968.585)	2.529.164	(1.741.078.724)	(208.802.302)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Macro Opportunities FX		Multi-Asset Income	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	EUR	EUR	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(2.168.497)	195.621	(150.944)	880.477
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	11.958	1.934	(506.021)	116.468
	(2.156.539)	197.555	(656.965)	996.945
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	184.774	87.386	(2.421.627)	293.434
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(22)	(47)	(33.291)	(538.853)
	184.752	87.339	(2.454.918)	(245.419)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	<b>(1.971.787)</b>	<b>284.894</b>	<b>(3.111.883)</b>	<b>751.526</b>

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Multi-Style Premia*	Next Generation Mobility	
	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(1.013.995)	(549.130)	20.357.896
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	116.393	(499.058)	(29.476)
	(897.602)	(1.048.188)	20.328.420
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.020.362	(55.382.736)	13.538.454
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(106.352)	(1.386.423)	(852.668)
	914.010	(56.769.159)	12.685.786
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	16.408	(57.817.347)	33.014.206

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Next Generation Space Economy <sup>1</sup> 31. Dezember 2022 US\$	Short Duration Emerging Market Debt 31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(131.045)	(702.327.934)	(265.753.807)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(16.020)	(6.224.469)	624.911
	(147.065)	(708.552.403)	(265.128.896)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(361.079)	(384.394.924)	(265.991.351)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	75.769	(8.121.043)	(17.405.752)
	(285.310)	(392.515.967)	(283.397.103)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(432.375)	(1.101.068.370)	(548.525.999)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Multi-Style Premia wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Short Duration High Yield SDG Engagement		Strategic Income	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(79.906.575)	4.194.256	(80.836.421)	39.096.063
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(374.053)	(31.411)	(5.386.191)	(596.149)
	(80.280.628)	4.162.845	(86.222.612)	38.499.914
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(9.473.114)	(43.463.260)	(159.562.278)	(72.936.559)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(11.794)	(30.063)	524.902	(4.843.253)
	(9.484.908)	(43.493.323)	(159.037.376)	(77.779.812)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(89.765.536)	(39.330.478)	(245.259.988)	(39.279.898)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>		Sustainable Emerging Market Corporate Debt	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(16.823.821)	(18.000)	(17.600.215)	(4.685.076)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	31.808	–	(91.884)	55.575
	(16.792.013)	(18.000)	(17.692.099)	(4.629.501)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(1.727.278)	(271.447)	(11.214.596)	(9.304.435)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	97	–	27.411	(116.701)
	(1.727.181)	(271.447)	(11.187.185)	(9.421.136)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(18.519.194)	(289.447)	(28.879.284)	(14.050.637)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	Systematic Global Sustainable Value	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(9.025.413)	(1.880.826)	1.181.359
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(406.646)	(1.207.717)	1.189
	(9.432.059)	(3.088.543)	1.182.548
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(12.332.378)	(2.242.740)	546.968
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	55.337	(68.617)	(149.479)
	(12.277.041)	(2.311.357)	397.489
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(21.709.100)	(5.399.900)	1.580.037

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Ultra Short Term Euro Bond		Uncorrelated Strategies	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	EUR	EUR	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(1.942.400)	4.524.460	(176.067.661)	108.617.741
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	140.647	(75.310)	(77.274.408)	69.025.149
	(1.801.753)	4.449.150	(253.342.069)	177.642.890
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(76.204.998)	(2.310.594)	258.005.909	(99.599.821)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(139.352)	137.979	73.007.817	(75.716.866)
	(76.344.350)	(2.172.615)	331.013.726	(175.316.687)
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(78.146.103)	2.276.535	77.671.657	2.326.203

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)**

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup> 31. Dezember 2022 US\$	US Equity 31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(48.728.968)	(2.458.372)	747.393
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(3.955.039)	(10.548)	77
	(52.684.007)	(2.468.920)	747.470
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	59.155.154	(2.885.247)	748.739
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(2.300.520)	–	–
	56.854.634	(2.885.247)	748.739
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	4.170.627	(5.354.167)	1.496.209



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Equity Index PutWrite		US Large Cap Value <sup>2</sup>	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(94.218.578)	51.723.420	(76.150.017)	(153)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(78.841)	(64.678)	(883.489)	–
	(94.297.419)	51.658.742	(77.033.506)	(153)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	6.625.073	73.930	49.637.130	78.828
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	144	191	1.102	–
	6.625.217	74.121	49.638.232	78.828
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(87.672.202)	51.732.863	(27.395.274)	78.675

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Long Short Equity		US Multi Cap Opportunities	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	21.917.080	(924.341)	44.244.243	49.360.433
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(32.867)	2.166	1.515	(503)
	21.884.213	(922.175)	44.245.758	49.359.930
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(58.748.168)	6.844.778	(194.265.895)	105.029.979
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	18.987	(862)	468	301
	(58.729.181)	6.843.916	(194.265.427)	105.030.280
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	<b>(36.844.968)</b>	<b>5.921.741</b>	<b>(150.019.669)</b>	<b>154.390.210</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Real Estate Securities		US Small Cap	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	10.997.795	11.630.725	44.417.166	93.733.844
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(22.220)	(6.222)	(94.020)	3.247
	10.975.575	11.624.503	44.323.146	93.737.091
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(312.649.923)	191.781.602	(199.642.072)	24.386.955
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	952	(581)	(56.422)	(68.442)
	(312.648.971)	191.781.021	(199.698.494)	24.318.513
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	(301.673.396)	203.405.524	(155.375.348)	118.055.604

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Small Cap Intrinsic Value	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	US\$	US\$
<b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>		
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	3.124.694	18.611.173
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(2.359)	(2.186)
	3.122.335	18.608.987
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(42.314.194)	9.489.490
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	218	3
	(42.313.976)	9.489.493
<b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>	<b>(39.191.641)</b>	<b>28.098.480</b>

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN

In Verfolgung seiner Anlageziele investiert der Fonds mit dem Ziel der Risikostreuung in übertragbare Wertpapiere. Durch die Anlage in Aktien und festverzinslichen Wertpapieren ergeben sich verschiedene Risiken für den Fonds, u. a. Markt-, Liquiditäts- und Kredit-/Gegenparteirisiken. Eine Darstellung der verschiedenen Risiken und der Strategien des Risikomanagements wird weiter unten gegeben. Zudem können die Folgen politischer, sozialer, wirtschaftlicher und diplomatischer Veränderungen oder der Zustand des Gesundheitswesens eine störende Wirkung auf die Marktpreise oder fairen Bewertungen von ausländischen Anlagen haben. Der beizulegende Zeitwert wird nach der in der Beschreibung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze umrissenen Methode ermittelt. Die Aufstellungen des Wertpapierbestands der Portfolios zum Ende des Geschäftsjahres sind repräsentativ für die im Geschäftsjahr gehaltenen Anlageformen.

**Marktrisiko**

Das Marktrisiko verkörpert das Potenzial für sowohl Verluste als auch Gewinne und beinhaltet das Preisrisiko, das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko.

Alle Wertpapieranlagen unterliegen dem Risiko eines Kapitalverlustes. Der Manager mildert dieses Risiko durch eine sorgfältige Auswahl der Wertpapiere und sonstigen Finanzinstrumente innerhalb vorgegebener Grenzen. Die gesamten Marktpositionen des Fonds werden vom Manager des Portfolios auf täglicher Basis überwacht und vierteljährlich von den Direktoren überprüft. Die Dividendenpapiere und Schuldtitel und zu Handelszwecken gehaltenen derivativen Finanzinstrumente des Fonds unterliegen einem Marktpreisänderungsrisiko, das sich aus der Ungewissheit hinsichtlich der künftigen Kursentwicklung der Instrumente ergibt.

**(a) Preisänderungsrisiko**

Das Preisänderungsrisiko ist das Risiko, dass die beizulegenden Zeitwerte von Wertpapieren infolge von Änderungen in den Indexständen und den Werten einzelner Wertpapiere fallen. Das Risikoexposure in Bezug auf den Handelspreis entsteht durch die Anlageportfolios des Fonds.

Der Großteil der Anlagen des Fonds ist gemäß Angabe im Verkaufsprospekt an anerkannten Börsen notiert oder wird an regulierten Märkten gehandelt. Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 hätte ein 10%iger Anstieg der Wertpapierkurse einen Anstieg des Nettovermögens und der Veränderungen des Nettovermögens eines jeden Portfolios wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt zur Folge gehabt. Eine entgegengesetzte Änderung in gleicher Höhe hätte zu einer Abnahme des Nettovermögens in gleicher Höhe geführt.

Portfolio	Währung	31. Dezember 2022	% des Nettovermögens	31. Dezember 2021	% des Nettovermögens
5G Connectivity	USD	96.175.643	9,69 %	232.329.678	9,70 %
Absolute Return Multi Strategy*	USD	677	0,00 %	1.988	0,00 %
Asian Debt - Hard Currency	USD	2.017.434	9,33 %	1.405.606	9,74 %
China A-Share Equity	CNY	1.531.769	9,43 %	2.371.918	9,71 %
China Bond	CNY	42.634.573	9,41 %	54.284.801	9,35 %
China Equity	USD	30.713.184	9,68 %	50.329.613	9,51 %
CLO Income	USD	11.481.421	8,32 %	13.272.979	8,86 %
Commodities <sup>1</sup>	USD	7.739.442	9,00 %	–	–
Corporate Hybrid Bond	EUR	162.716.118	9,13 %	225.981.422	9,19 %
Diversified Currency**	USD	–	–	–	–
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	9.214.528	9,38 %	14.138.644	9,75 %
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	233.467.771	9,37 %	344.228.680	9,53 %
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	130.283.522	9,40 %	190.151.066	9,04 %
Emerging Market Debt Blend	USD	44.932.225	9,56 %	88.189.930	9,31 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	5.035.590	9,28 %	4.396.647	9,28 %
Emerging Markets Equity	USD	18.912.096	9,86 %	37.774.883	9,72 %
Emerging Markets Select Equity	USD	9.042.698	9,64 %	12.316.716	9,83 %
Euro Bond Absolute Return	EUR	4.624.076	9,53 %	4.896.927	9,04 %
Euro Opportunistic Bond	EUR	847.795	9,12 %	1.038.626	9,26 %
European High Yield Bond	EUR	3.062.817	9,44 %	3.745.012	9,64 %
European Sustainable Equity <sup>2</sup>	EUR	17.438.883	9,92 %	11.041.694	9,70 %
Event Driven <sup>1</sup>	USD	3.474.117	8,38 %	–	–
Global Bond	USD	13.167.283	9,77 %	17.342.431	9,61 %
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	15.479.144	9,65 %	21.788.013	9,32 %
Global Equity Index PutWrite***	USD	–	–	–	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio	Währung	31. Dezember 2022	% des Nettovermögens	31. Dezember 2021	% des Nettovermögens
Global Flexible Credit Income	USD	37.314.259	9,46 %	60.955.943	8,64 %
Global High Yield SDG Engagement	USD	27.747.950	8,23 %	3.850.031	9,72 %
Global High Yield Sustainable Action	USD	1.418.914	9,43 %	1.688.265	9,59 %
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	USD	8.189.868	9,53 %	9.689.963	9,81 %
Global Opportunistic Bond	USD	7.458.139	9,80 %	9.399.665	9,97 %
Global Real Estate Securities	USD	3.792.511	9,72 %	5.046.811	9,92 %
Global Sustainable Equity <sup>2</sup>	USD	13.052.448	9,92 %	20.253.655	9,93 %
Global Equity Megatrends	USD	7.946.534	10,02 %	8.195.541	9,86 %
High Yield Bond	USD	214.442.381	9,33 %	301.954.239	9,43 %
InnovAsia 5G2	USD	1.424.712	9,66 %	2.573.543	9,60 %
Japan Equity Engagement	JPY	2.011.077.140	9,79 %	1.339.574.187	11,07 %
Macro Opportunities FX	EUR	3.132.477	9,94 %	4.444.669	9,96 %
Multi-Asset Income	USD	858.422	7,55 %	1.933.051	8,51 %
Multi-Style Premia****	USD	–	–	–	–
Next Generation Mobility	USD	13.848.098	9,36 %	20.346.725	9,23 %
Next Generation Space Economy <sup>1</sup>	USD	798.167	9,40 %	–	–
Short Duration Emerging Market Debt	USD	487.580.603	9,51 %	663.613.924	9,57 %
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	53.097.443	9,54 %	60.604.037	9,40 %
Strategic Income	USD	144.106.190	10,89 %	156.173.451	10,81 %
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	USD	2.859.917	8,96 %	2.221.617	8,99 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	USD	14.670.976	9,26 %	–	–
Systematic Global Sustainable Value	USD	4.775.068	9,94 %	2.079.011	9,95 %
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	79.837.235	9,72 %	103.853.232	8,95 %
Uncorrelated Strategies	USD	206.595.785	6,60 %	89.702.424	3,48 %
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	53.936.721	7,58 %	–	–
US Equity	USD	2.909.518	9,25 %	837.819	9,38 %
US Equity Index PutWrite	USD	63.457.321	9,33 %	38.933.923	8,20 %
US Large Cap Value <sup>2</sup>	USD	168.949.697	9,56 %	204.403	9,99 %
US Long Short Equity	USD	17.625.383	7,96 %	39.905.233	8,42 %
US Multi Cap Opportunities	USD	44.117.461	10,00 %	78.114.822	10,00 %
US Real Estate Securities	USD	62.739.110	9,68 %	101.158.651	9,90 %
US Small Cap	USD	57.949.243	9,78 %	81.154.992	9,87 %
US Small Cap Intrinsic Value	USD	18.688.937	9,63 %	14.258.231	9,28 %

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

\*\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\*\*\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Das sonstige Preisrisiko ist das Risiko, dass sich der Wert der Finanzinstrumente aufgrund von Marktpreisschwankungen (mit Ausnahme solcher, die von Zinsänderungs- oder Währungsrisiken hervorgerufen werden) verändert, sei es, dass diese Änderungen spezifischen Faktoren eines einzelnen Instruments oder seinem Emittenten zuzuordnen sind, oder dass sich alle Faktoren auf alle am Markt gehandelten Instrumente auswirken. Da der Großteil der Finanzinstrumente des Fonds zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen und die Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst werden, wirken sich Veränderungen der Marktbedingungen unmittelbar auf den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten aus.

Das Preisrisiko wird durch den Manager gesteuert, indem er in ein diversifiziertes Spektrum von Wertpapieren auf verschiedenen Märkten investiert.

In den nachstehenden Tabellen sind die Preisrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

5G Connectivity	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	88.330.793	8,90	121.695.757	5,08
Euro	61.082.055	6,15	121.011.426	5,05
Hongkong-Dollar	19.691.830	1,98	48.495.712	2,03
Japanischer Yen	92.855.794	9,35	200.555.967	8,37
Neuer taiwanesischer Dollar	46.686.340	4,70	226.936.266	9,47
Südkoreanischer Won	7.609.911	0,77	129.636.239	5,41
US-Dollar	636.637.996	64,11	1.479.759.200	61,77
	952.894.719	95,96	2.328.090.567	97,18
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	8.861.706	0,89	(4.793.792)	(0,20)

Absolute Return Multi Strategy*	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	6.766	0,00	31.388	0,00
	6.766	0,00	31.388	0,00
	6.766	0,00	31.388	0,00
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	–	–	(11.507)	0,00

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Asian Debt - Hard Currency	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	18.090.069	83,65	12.557.968	87,03
	18.090.069	83,65	12.557.968	87,03
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	633.146	2,93	457.067	3,17
US-Dollar	1.457.840	6,74	1.042.236	7,22
	2.090.986	9,67	1.499.303	10,39
	20.181.055	93,32	14.057.271	97,42
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(6.712)	(0,03)	(1.208)	(0,01)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

China A-Share Equity	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert CNY	% des Netto- vermögens	Marktwert CNY	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	14.345.271	88,32	22.083.382	90,40
Hongkong-Dollar	972.422	5,99	1.635.802	6,70
	15.317.693	94,31	23.719.184	97,10
<b>China Bond</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert CNY	% des Netto- vermögens	Marktwert CNY	% des Netto- vermögens
Zu Handelszwecken gehaltene Einlagenzertifikate:				
Chinesischer Yuan Renminbi	88.103.380	19,45	38.863.400	6,69
US-Dollar	4.820.965	1,07	–	–
	92.924.345	20,52	38.863.400	6,69
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Chinesischer Yuan Renminbi	163.677.183	36,13	322.380.016	55,52
US-Dollar	108.488.656	23,94	63.405.863	10,91
	272.165.839	60,07	385.785.879	66,43
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chinesischer Yuan Renminbi	60.073.670	13,26	119.228.610	20,53
	425.163.854	93,85	543.877.889	93,65
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.181.877	0,26	(1.029.880)	(0,18)
<b>China Equity</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	130.092.894	40,98	209.868.777	39,64
Hongkong-Dollar	163.724.575	51,58	278.789.522	52,67
US-Dollar	13.032.219	4,11	14.709.115	2,78
	306.849.688	96,67	503.367.414	95,09
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	282.149	0,09	(71.285)	(0,01)
<b>CLO Income</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	9.941.110	7,20	5.852.148	3,91
US-Dollar	102.929.843	74,57	127.422.801	85,04
	112.870.953	81,77	133.274.949	88,95
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.943.252	1,41	(545.159)	(0,37)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Commodities <sup>1</sup>	31. Dezember 2022			
	Marktwert US\$	% des Nettover- mögens		
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	39.453.874	45,88		
	39.453.874	45,88		
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	10.530.836	12,25		
	10.530.836	12,25		
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	26.223.262	30,49		
	76.207.972	88,62		
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.186.450	1,38		
<b>Corporate Hybrid Bond</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	1.059.438.369	59,45	1.350.751.228	54,94
Britisches Pfund	358.590.800	20,12	432.121.189	17,58
US-Dollar	219.972.176	12,34	467.621.921	19,02
	1.638.001.345	91,91	2.250.494.338	91,54
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	10.317.170	0,58	11.305.839	0,46
	1.648.318.515	92,49	2.261.800.177	92,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(37.445.575)	(2,10)	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	16.288.239	0,91	(1.985.960)	(0,08)
<b>Emerging Market Debt - Hard Currency</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	14.662.054	0,59	24.460.840	0,68
US-Dollar	770.315.416	30,91	1.137.653.100	31,49
	784.977.470	31,50	1.162.113.940	32,17
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	368.795.821	14,80	461.597.273	12,78
US-Dollar	1.139.225.120	45,72	1.777.695.801	49,21
	1.508.020.941	60,52	2.239.293.074	61,99
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	16.110.000	0,65	16.683.000	0,46
	2.309.108.411	92,67	3.418.090.014	94,62
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	25.569.299	1,03	24.196.787	0,67

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Zu Handelszwecken gehaltene Einlagenzertifikate:				
Chinesischer Yuan Renminbi	18.492.177	1,34	–	–
	18.492.177	1,34	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Chinesischer Yuan Renminbi	7.285.480	0,52	14.336.588	0,68
Kolumbianischer Peso	8.802.670	0,64	12.726.125	0,61
Mexikanischer Peso	6.380.573	0,46	6.310.771	0,30
	22.468.723	1,62	33.373.484	1,59
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chilenischer Peso	26.104.583	1,88	17.806.139	0,85
Chinesischer Yuan Renminbi	102.801.260	7,42	208.090.979	9,90
Kolumbianischer Peso	74.598.060	5,38	125.121.951	5,95
Tschechische Krone	73.521.592	5,30	75.024.791	3,57
Peso Dominikanische Republik	2.610.187	0,19	2.962.796	0,14
Ägyptisches Pfund	–	–	45.498.936	2,16
Ghanaischer Cedi	4.108.737	0,30	9.558.240	0,46
Ungarischer Forint	5.996.791	0,43	51.531.266	2,45
Indische Rupie	–	–	45.051.313	2,14
Indonesische Rupiah	137.097.295	9,89	214.899.581	10,22
Japanischer Yen	32.421	0,00	42.063	0,00
Kasachischer Tenge	–	–	24.645.747	1,17
Malaysischer Ringgit	139.277.177	10,05	125.685.919	5,98
Mexikanischer Peso	144.597.744	10,43	158.739.218	7,55
Peruanischer Sol	33.296.058	2,40	50.314.139	2,39
Polnischer Zloty	124.542.085	8,98	100.591.926	4,78
Rumänischer neuer Leu	55.708.597	4,02	59.773.438	2,84
Russischer Rubel	–	–	104.432.490	4,97
Serbischer Dinar	4.872.169	0,35	6.804.497	0,32
Südafrikanischer Rand	178.596.837	12,88	144.132.651	6,86
Thailändischer Baht	125.927.439	9,08	172.318.990	8,20
Türkische Lira	18.929.286	1,37	14.754.024	0,70
Uganda-Schilling	7.306.313	0,53	9.982.293	0,48
US-Dollar	15.066.161	1,09	19.358.322	0,92
Uruguayischer Peso	2.636.726	0,19	2.611.921	0,12
Sambischer Kwacha	2.725.498	0,20	6.478.056	0,31
	1.280.353.016	92,36	1.796.211.686	85,43

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	15.136.550	1,09	16.157.350	0,77
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Israelischer Schekel	–	–	45.122.405	2,14
US-Dollar	–	–	41.799.284	1,99
	–	–	86.921.689	4,13
	1.336.450.466	96,41	1.932.664.209	91,92
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(33.615.251)	(2,42)	(31.153.552)	(1,49)

Emerging Market Debt Blend

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kolumbianischer Peso	3.398.251	0,72	4.867.297	0,51
Euro	1.032.323	0,22	3.042.283	0,32
Mexikanischer Peso	4.264.869	0,91	4.220.228	0,44
US-Dollar	141.206.810	30,03	287.371.880	30,33
	149.902.253	31,88	299.501.688	31,60
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chilenischer Peso	2.895.335	0,61	3.120.725	0,33
Chinesischer Yuan Renminbi	15.427.534	3,28	49.916.899	5,27
Kolumbianischer Peso	12.577.245	2,67	27.783.926	2,93
Tschechische Krone	11.315.314	2,41	18.336.084	1,94
Peso Dominikanische Republik	624.770	0,13	709.170	0,08
Ägyptisches Pfund	–	–	9.632.254	1,02
Euro	17.857.261	3,80	31.360.791	3,31
Ghanaischer Cedi	815.776	0,17	2.025.722	0,21
Ungarischer Forint	616.714	0,13	6.935.487	0,73
Indische Rupie	–	–	12.670.682	1,34
Indonesische Rupiah	22.600.787	4,81	43.126.122	4,55
Kasachischer Tenge	–	–	5.352.571	0,57
Malaysischer Ringgit	22.744.336	4,84	29.540.288	3,12
Mexikanischer Peso	21.682.994	4,61	29.305.404	3,09
Peruanischer Sol	7.750.139	1,65	12.033.217	1,27
Polnischer Zloty	24.290.359	5,17	25.229.357	2,66
Rumänischer neuer Leu	8.837.453	1,88	11.304.224	1,19
Russischer Rubel	–	–	17.439.617	1,84
Serbischer Dinar	873.537	0,19	1.565.756	0,17
Südafrikanischer Rand	27.262.285	5,80	30.788.738	3,25
Thailändischer Baht	20.529.539	4,37	42.305.069	4,46
Türkische Lira	3.313.333	0,70	2.964.720	0,31

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):				
Uganda-Schilling	1.090.644	0,23	2.449.206	0,26
US-Dollar	63.974.006	13,61	137.823.902	14,54
Uruguayischer Peso	600.568	0,13	594.919	0,06
Sambischer Kwacha	432.664	0,09	1.439.903	0,15
	288.112.593	61,28	555.754.753	58,65
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	13.380.558	2,84	16.177.245	1,71
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Israelischer Schekel	–	–	9.658.142	1,02
US-Dollar	–	–	4.456.785	0,47
	–	–	14.114.927	1,49
	451.395.404	96,00	885.548.613	93,45
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(2.073.158)	(0,44)	(3.649.310)	(0,38)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	81.235	0,15	119.815	0,25
US-Dollar	7.430.806	13,69	9.602.085	20,27
	7.512.041	13,84	9.721.900	20,52
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chilenischer Peso	375.653	0,69	211.080	0,45
Chinesischer Yuan Renminbi	2.031.464	3,74	2.028.714	4,28
Kolumbianischer Peso	801.082	1,48	767.389	1,62
Tschechische Krone	883.384	1,63	537.080	1,13
Euro	12.310.300	22,68	8.498.338	17,93
Ungarischer Forint	207.182	0,38	303.265	0,64
Indonesische Rupiah	2.265.664	4,17	1.756.813	3,71
Malaysischer Ringgit	2.105.774	3,88	1.036.920	2,19
Mexikanischer Peso	2.684.300	4,95	1.639.488	3,46
Peruanischer Sol	284.758	0,53	289.822	0,61
Polnischer Zloty	1.308.790	2,41	757.850	1,60
Rumänischer neuer Leu	718.745	1,32	290.464	0,61
Russischer Rubel	–	–	692.350	1,46
Thailändischer Baht	1.580.752	2,91	1.166.720	2,46
US-Dollar	14.709.282	27,10	11.958.709	25,24
Uruguayischer Peso	18.744	0,04	18.568	0,04
	42.285.874	77,91	31.953.570	67,43

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Israelischer Schekel	–	–	1.400.581	2,95
Kasachischer Tenge	–	–	134.615	0,28
US-Dollar	–	–	140.868	0,30
	–	–	1.676.064	3,53
	49.797.915	91,75	43.351.534	91,48
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	557.983	1,03	614.939	1,30

Emerging Markets Equity	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Brasilianischer Real	7.583.703	3,95	8.714.329	2,24
Kanadischer Dollar	1.690.432	0,88	3.130.580	0,81
Chinesischer Yuan Renminbi	22.324.279	11,64	43.642.733	11,23
Euro	–	–	1.520.655	0,39
Hongkong-Dollar	37.055.894	19,32	72.413.947	18,63
Ungarischer Forint	2.147.576	1,12	6.783.162	1,74
Indische Rupie	32.046.728	16,71	62.452.671	16,07
Indonesische Rupiah	2.888.935	1,51	2.967.516	0,76
Mexikanischer Peso	2.870.110	1,50	2.171.160	0,56
Neuer taiwanesischer Dollar	11.740.474	6,12	22.867.521	5,88
Polnischer Zloty	2.615.773	1,36	6.975.686	1,79
Britisches Pfund	4.132.511	2,15	7.101.998	1,83
Katar-Rial	1.894.532	0,99	–	–
Saudi-Arabischer Riyal	6.654.852	3,47	2.161.224	0,56
Singapur-Dollar	–	–	1.161.204	0,30
Südafrikanischer Rand	5.910.698	3,08	9.320.157	2,40
Südkoreanischer Won	21.051.735	10,98	42.058.492	10,82
Thailändischer Baht	992.701	0,52	2.608.267	0,67
VAE-Dirham	2.750.497	1,43	–	–
US-Dollar	22.382.576	11,67	79.908.018	20,56
	188.734.006	98,40	377.959.320	97,24
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	386.954	0,20	(210.490)	(0,06)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Markets Select Equity	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Brasilianischer Real	2.793.292	2,98	2.825.725	2,25
Chinesischer Yuan Renminbi	9.457.406	10,09	14.177.796	11,31
Euro	–	–	672.155	0,54
Hongkong-Dollar	19.787.346	21,10	23.938.923	19,10
Ungarischer Forint	–	–	1.408.887	1,12
Indische Rupie	7.608.229	8,11	10.388.920	8,29
Indonesische Rupiah	2.132.626	2,27	1.231.782	0,98
Mexikanischer Peso	1.624.815	1,73	694.142	0,55
Neuer taiwanesischer Dollar	13.804.257	14,72	18.926.584	15,10
Polnischer Zloty	1.515.194	1,62	2.529.258	2,02
Britisches Pfund	1.390.895	1,48	1.541.973	1,23
Katar-Rial	1.034.075	1,10	–	–
Saudi-Arabischer Riyal	1.404.943	1,50	739.943	0,59
Singapur-Dollar	–	–	535.147	0,43
Südafrikanischer Rand	3.006.465	3,21	2.099.278	1,67
Südkoreanischer Won	11.727.350	12,51	17.311.039	13,81
Thailändischer Baht	756.239	0,81	829.213	0,66
VAE-Dirham	1.362.386	1,45	–	–
US-Dollar	11.021.461	11,76	23.316.394	18,60
	90.426.979	96,44	123.167.159	98,25
Euro Bond Absolute Return	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	2.319.216	4,78	2.053.891	3,79
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Dänische Krone	995.767	2,05	626.562	1,16
Euro	22.942.484	47,28	16.673.920	30,78
	23.938.251	49,33	17.300.482	31,94
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	19.650.553	40,49	28.837.303	53,24
US-Dollar	–	–	459.422	0,85
	19.650.553	40,49	29.296.725	54,09
	45.908.020	94,60	48.651.098	89,82
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	332.738	0,69	318.174	0,59

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Euro Opportunistic Bond	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	462.816	4,98	298.264	2,66
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	4.079.176	43,88	4.427.757	39,49
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	4.005.023	43,09	5.718.588	51,01
	8.547.015	91,95	10.444.609	93,16
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(69.064)	(0,74)	(58.347)	(0,52)

European High Yield Bond	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	215.121	0,66	219.984	0,57
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	28.338.871	87,32	30.578.501	78,68
Britisches Pfund	3.726.129	11,48	5.983.867	15,39
	32.065.000	98,80	36.562.368	94,07
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
Euro	202.519	0,63	211.251	0,54
	32.482.640	100,09	36.993.603	95,18
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(1.854.475)	(5,72)	456.520	1,18

European Sustainable Equity <sup>2</sup>	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Dänische Krone	8.595.893	4,89	5.389.190	4,73
Euro	81.995.074	46,63	49.617.406	43,57
Norwegische Krone	7.133.274	4,06	3.565.323	3,13
Britisches Pfund	24.444.336	13,90	22.145.341	19,44
Schwedische Krone	13.773.588	7,83	7.468.968	6,56
Schweizer Franken	35.431.220	20,15	19.959.903	17,53
US-Dollar	3.015.442	1,71	2.270.811	1,99
	174.388.827	99,17	110.416.942	96,95

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Event Driven <sup>1</sup>	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Nettover- mögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	33.823.354	81,61		
	33.823.354	81,61		
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto				
	917.817	2,21		
<b>Global Bond</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	2.423.190	1,80	2.795.723	1,55
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	2.228.563	1,65	1.267.523	0,70
Britisches Pfund	1.289.899	0,96	4.557.346	2,53
US-Dollar	5.343.245	3,96	9.968.317	5,53
	8.861.707	6,57	15.793.186	8,76
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kanadischer Dollar	1.022.908	0,76	1.534.520	0,85
Euro	10.341.319	7,67	16.601.282	9,20
Britisches Pfund	1.763.306	1,31	3.895.817	2,16
US-Dollar	31.231.661	23,16	30.936.469	17,15
	44.359.194	32,90	52.968.088	29,36
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Australischer Dollar	9.709	0,01	2.001.354	1,11
Kanadischer Dollar	10.329.838	7,66	13.849.394	7,68
Euro	9.397.938	6,97	16.964.721	9,40
Indonesische Rupiah	1.164.003	0,86	–	–
Japanischer Yen	5.959.363	4,42	17.444.121	9,67
Mexikanischer Peso	2.872.675	2,13	–	–
Neuseeländischer Dollar	1.604.915	1,19	3.260.125	1,81
Polnischer Zloty	–	–	268.836	0,15
Britisches Pfund	2.840.463	2,11	3.927.472	2,17
Südkoreanischer Won	5.630.012	4,18	–	–
US-Dollar	13.861.093	10,28	24.480.248	13,57
	53.670.009	39,81	82.196.271	45,56
Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:				
US-Dollar	19.062.981	14,14	18.239.492	10,11
Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen:				
US-Dollar	1.706.806	1,27	–	–
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	791.814	0,59	1.399.195	0,78
	130.875.701	97,08	173.391.955	96,12
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto				
	797.126	0,59	32.350	0,00

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	150.336.737	93,73	206.932.749	88,53
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	3.931.136	2,45	11.000.752	4,70
	154.267.873	96,18	217.933.501	93,23
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	523.570	0,33	(53.372)	(0,02)

Global Equity Index PutWrite\*

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 kein Engagement in Preisrisiko.

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Global Equity Megatrends	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Kanadischer Dollar	4.945.150	6,23	3.713.058	4,47
Britisches Pfund	4.451.857	5,61	4.115.988	4,95
US-Dollar	70.068.328	88,31	74.126.360	89,14
	79.465.335	100,15	81.955.406	98,56

Global Flexible Credit Income	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	5.247.334	1,33	–	–
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	24.079.041	6,10	18.193.868	2,59
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	55.474.132	14,06	76.564.922	10,86
Britisches Pfund	10.688.891	2,71	13.086.358	1,86
US-Dollar	250.001.101	63,37	491.209.309	69,65
	316.164.124	80,14	580.860.589	82,37
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	1.976.528	0,50	3.905.502	0,55
US-Dollar	7.841.259	1,99	8.873.396	1,26
	9.817.787	2,49	12.778.898	1,81
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	338.564	0,08	474.751	0,07
	355.646.850	90,14	612.308.106	86,84
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	17.495.741	4,44	(2.748.680)	(0,40)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global High Yield SDG Engagement	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	–	–	1.002.292	2,53
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	47.186.640	14,00	7.364.982	18,58
Britisches Pfund	6.749.530	2,01	1.583.392	4,00
US-Dollar	219.069.164	65,01	28.883.727	72,89
	273.005.334	81,02	37.832.101	95,47
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	1.013.476	0,31	–	–
	274.018.810	81,33	38.834.393	98,00
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	3.460.687	1,02	(334.087)	(0,84)
<b>Global High Yield Sustainable Action</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	3.765.913	25,03	2.981.845	16,94
Britisches Pfund	792.792	5,27	939.457	5,34
US-Dollar	9.884.966	65,69	12.847.534	73,00
	14.443.671	95,99	16.768.836	95,28
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	95.881	0,64	54.859	0,31
	14.539.552	96,63	16.823.695	95,59
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(350.409)	(2,33)	58.957	0,33
<b>Global Investment Grade Credit</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kanadischer Dollar	1.894.286	2,21	–	–
Euro	17.214.963	20,04	24.193.783	24,49
Britisches Pfund	4.004.142	4,66	5.057.769	5,12
US-Dollar	57.653.972	67,11	67.192.894	68,00
	80.767.363	94,02	96.444.446	97,61
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	2.758.010	3,21	–	–
	83.525.373	97,23	96.444.446	97,61
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(1.626.695)	(1,90)	455.185	0,46

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	307.820	0,40	406.473	0,43
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	616.355	0,81	1.288.292	1,37
Britisches Pfund	91.718	0,12	–	–
US-Dollar	3.582.029	4,71	9.519.509	10,10
	4.290.102	5,64	10.807.801	11,47
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	24.004.584	31,54	26.908.061	28,55
Britisches Pfund	3.799.491	4,99	6.527.188	6,93
US-Dollar	7.627.624	10,02	10.220.636	10,84
	35.431.699	46,55	43.655.885	46,32
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Kanadischer Dollar	–	–	1.325.852	1,41
Chinesischer Yuan Renminbi	3.581.244	4,70	4.772.529	5,06
Tschechische Krone	413.371	0,54	486.009	0,52
Euro	5.925.902	7,79	9.663.655	10,25
Indonesische Rupiah	324.042	0,42	–	–
Japanischer Yen	106.443	0,14	149.730	0,16
Mexikanischer Peso	1.444.773	1,90	–	–
Neuseeländischer Dollar	3.726.450	4,90	3.135.788	3,33
Polnischer Zloty	347.647	0,46	463.800	0,49
Britisches Pfund	465.305	0,61	–	–
Thailändischer Baht	265.740	0,35	–	–
US-Dollar	8.110.126	10,66	5.471.542	5,81
	24.711.043	32,47	25.468.905	27,03
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	107.216	0,14	150.344	0,16
US-Dollar	1.694.000	2,23	5.604.000	5,95
	1.801.216	2,37	5.754.344	6,11
Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:				
US-Dollar	10.458.233	13,74	6.090.483	6,46
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	–	–	3.123.203	3,31
	77.000.113	101,17	95.307.094	101,13
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(2.418.728)	(3,18)	(1.310.440)	(1,39)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Kanadischer Dollar	–	–	557.889	1,10
Euro	967.525	2,48	1.505.832	2,96
Hongkong-Dollar	2.886.361	7,40	1.927.556	3,79
Japanischer Yen	1.896.887	4,86	2.656.027	5,22
Singapur-Dollar	1.095.282	2,81	902.454	1,78
	6.846.055	17,55	7.549.758	14,85
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
Australischer Dollar	1.287.061	3,30	1.937.573	3,81
Kanadischer Dollar	1.814.574	4,65	1.682.673	3,30
Euro	964.954	2,47	642.524	1,26
Hongkong-Dollar	165.184	0,42	–	–
Japanischer Yen	1.709.702	4,38	2.437.474	4,79
Britisches Pfund	3.081.950	7,90	6.230.538	12,24
Singapur-Dollar	404.924	1,04	463.450	0,91
US-Dollar	20.932.449	53,64	29.712.068	58,39
	30.360.798	77,80	43.106.300	84,70
	37.206.853	95,35	50.656.058	99,55
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	718.252	1,84	(187.946)	(0,37)

Global Sustainable Equity	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Australischer Dollar	–	–	1.880.158	0,92
Dänische Krone	2.087.272	1,59	3.289.153	1,61
Euro	13.586.367	10,32	21.366.720	10,48
Japanischer Yen	1.579.691	1,20	2.273.534	1,12
Norwegische Krone	4.294.333	3,26	5.482.822	2,69
Britisches Pfund	4.178.560	3,18	14.792.938	7,25
Schwedische Krone	3.754.615	2,85	2.576.782	1,26
Schweizer Franken	5.969.089	4,54	10.013.000	4,91
US-Dollar	95.074.555	72,26	140.861.439	69,05
	130.524.482	99,20	202.536.546	99,29

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

High Yield Bond	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	21.830.306	0,95	43.351.226	1,35
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	3.839.814	0,16	–	–
US-Dollar	1.978.713.612	86,08	2.791.815.047	87,15
	1.982.553.426	86,24	2.791.815.047	87,15
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	18.294.706	0,80	30.444.245	0,95
US-Dollar	–	–	5.432.387	0,17
	18.294.706	0,80	35.876.632	1,12
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	91.635.501	3,99	167.447.462	5,23
	2.114.313.939	91,98	3.038.490.367	94,85
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	30.109.875	1,31	(18.947.974)	(0,59)

InnovAsia 5G	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	2.183.240	14,80	932.486	3,48
Hongkong-Dollar	212.641	1,44	–	–
Euro	–	–	622.820	2,32
Indische Rupie	539.135	3,66	1.558.488	5,82
Japanischer Yen	3.928.339	26,64	4.255.958	15,88
Malaysischer Ringgit	319.895	2,17	454.057	1,70
Neuer taiwanesischer Dollar	3.802.814	25,78	9.809.213	36,61
Singapur-Dollar	505.401	3,43	1.391.672	5,19
Südkoreanischer Won	515.684	3,50	3.142.112	11,73
US-Dollar	1.472.362	9,98	3.678.508	13,73
Vietnamesischer Dong	392.997	2,66	–	–
	13.872.508	94,06	25.845.314	96,46
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	374.607	2,54	(109.881)	(0,41)

Japan Equity Engagement	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert JPY	% des Netto- vermögens	Marktwert JPY	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Japanischer Yen	20.207.455.300	98,37	13.395.215.072	110,65
	20.207.455.300	98,37	13.395.215.072	110,65
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(96.683.905)	(0,47)	526.794	0,00

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

## Macro Opportunities FX

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	24.967.521	79,24	42.828.912	96,01
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	2.778.639	8,82	200.575	0,45
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Euro	4.389.983	13,93	2.209.782	4,95
	32.136.143	101,99	45.239.269	101,41
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(811.369)	(2,58)	(792.577)	(1,78)

## Multi-Asset Income

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	7.644	0,07	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	2.941.980	25,88	4.605.411	20,28
Britisches Pfund	213.717	1,88	442.359	1,95
US-Dollar	1.725.211	15,18	3.749.715	16,52
	4.880.908	42,94	8.797.485	38,75
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Australischer Dollar	43.240	0,38	133.180	0,59
Brasilianischer Real	17.407	0,15	57.129	0,25
Kanadischer Dollar	–	–	5.789	0,03
Dänische Krone	–	–	7.130	0,03
Euro	151.800	1,34	395.650	1,74
Hongkong-Dollar	98.904	0,87	381.317	1,68
Israelischer Schekel	–	–	12.574	0,06
Japanischer Yen	108.100	0,95	281.769	1,24
Neuer taiwanesischer Dollar	23.212	0,20	202.249	0,89
Norwegische Krone	–	–	12.289	0,06
Britisches Pfund	73.519	0,65	300.253	1,32
Singapur-Dollar	–	–	14.366	0,06
Südafrikanischer Rand	8.339	0,07	187	0,00
Südkoreanischer Won	30.543	0,27	151.900	0,67
Schwedische Krone	–	–	47.208	0,21
Schweizer Franken	46.212	0,41	214.277	0,94
US-Dollar	2.247.172	19,77	3.998.480	17,61
	2.848.448	25,06	6.215.747	27,38

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Multi-Asset Income (Fortsetzung)

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	311.601	2,74	1.293.771	5,70
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	8.560	0,08	–	–
US-Dollar	593.625	5,22	1.484.544	6,54
	602.185	5,30	1.484.544	6,54
Für den Handel gehaltene Participatory Notes:				
Australischer Dollar	–	–	–	–
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
Australischer Dollar	–	–	4.010	0,02
Singapur-Dollar	–	–	2.328	0,01
Südafrikanischer Rand	2.166	0,02	–	–
US-Dollar	362.642	3,19	1.482.081	6,52
	364.808	3,21	1.488.419	6,55
	9.015.594	79,32	19.279.966	84,92
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(431.372)	(3,80)	50.542	0,21

Multi-Style Premia\*

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 kein Engagement in Preisrisiko.

\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

Next Generation Mobility

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Kanadischer Dollar	2.312.662	1,56	4.254.965	1,93
Chinesischer Yuan Renminbi	1.537.306	1,04	575.180	0,26
Euro	5.688.591	3,84	10.364.682	4,70
Hongkong-Dollar	3.880.762	2,62	5.890.426	2,67
Japanischer Yen	2.867.915	1,94	4.994.304	2,27
Neuer taiwanesischer Dollar	1.016.740	0,69	2.917.848	1,32
Schwedische Krone	1.854.267	1,25	2.730.238	1,24
US-Dollar	117.719.542	79,54	171.838.216	77,94
	136.877.785	92,48	203.565.859	92,33
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	1.522.531	1,03	–	–
	138.400.316	93,51	203.565.859	92,33
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	80.667	0,06	(98.610)	(0,05)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

	31. Dezember 2022	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:		
Chinesischer Yuan Renminbi	103.745	1,22
Euro	1.179.050	13,89
Japanischer Yen	172.026	2,03
Neuer taiwanesischer Dollar	134.551	1,58
Britisches Pfund	357.829	4,21
Singapur-Dollar	270.258	3,18
Südkoreanischer Won	288.684	3,40
US-Dollar	5.475.531	64,49
	7.981.674	94,00

## Short Duration Emerging Market Debt

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	41.269.865	0,81	69.562.556	1,00
US-Dollar	3.486.415.742	68,03	4.705.166.429	67,85
	3.527.685.607	68,84	4.774.728.985	68,85
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	225.469.117	4,40	123.244.298	1,78
US-Dollar	980.358.585	19,13	1.661.624.983	23,96
	1.205.827.702	23,53	1.784.869.281	25,74
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	70.347.000	1,37	72.849.100	1,05
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	51.075.667	1,00	–	–
	4.854.935.976	94,74	6.632.447.366	95,64
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1.843.240)	(0,04)	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	22.713.291	0,44	3.691.873	0,05

## Short Duration High Yield SDG Engagement

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	10.810.063	1,94	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	477.638.711	85,85	561.613.956	87,15
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	1.221.039	0,22	2.288.465	0,36
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	23.578.927	4,24	46.278.962	7,18
	513.248.740	92,25	610.181.383	94,69
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	17.725.693	3,18	(4.141.018)	(0,65)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Strategic Income	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	772.053	0,06	1.038.942	0,07
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	105.467.359	7,97	75.102.043	5,20
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kanadischer Dollar	–	–	362.709	0,02
Euro	30.404.992	2,30	74.396.704	5,15
Britisches Pfund	5.246.297	0,40	14.409.669	1,00
US-Dollar	601.915.888	45,50	483.902.351	33,49
	637.567.177	48,20	573.071.433	39,66
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Kolumbianischer Peso	1.405.082	0,11	3.048.291	0,21
Ungarischer Forint	1.753.111	0,13	–	–
Indonesische Rupiah	3.588.355	0,27	5.608.275	0,39
Mexikanischer Peso	2.721.504	0,21	4.261.714	0,29
Peruanischer Sol	4.407.353	0,33	19.635	0,00
Russischer Rubel	–	–	3.714.745	0,26
Südafrikanischer Rand	1.824.633	0,14	3.050.227	0,21
Türkische Lira	1.705.418	0,13	1.563.791	0,11
US-Dollar	225.951.909	17,08	262.497.956	18,17
	243.357.365	18,40	283.764.634	19,64
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	738.685	0,05	1.035.820	0,07
US-Dollar	57.487.152	4,35	64.233.144	4,45
	58.225.837	4,40	65.268.964	4,52
Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:				
US-Dollar	346.893.475	26,22	261.330.721	18,09
Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen:				
US-Dollar	20.744.098	1,57	17.076.840	1,18
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	579.804	0,04	99.300.565	6,87
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	8.017.122	0,61	190.052.290	13,15
	1.421.624.290	107,47	1.566.006.432	108,38
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	19.437.605	1,47	(4.271.925)	(0,30)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	27.495.016	86,13	20.977.042	84,86
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	837.924	2,63	1.236.942	5,00
	28.332.940	88,76	22.213.984	89,86
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	266.230	0,83	2.187	0,01

Sustainable Emerging Market Corporate Debt	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	–	–	514.743	0,36
US-Dollar	86.982.672	88,54	137.489.412	94,78
	86.982.672	88,54	138.004.155	95,14
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	2.325.515	2,37	73.880	0,05
US-Dollar	2.075.893	2,11	2.763.485	1,90
	4.401.408	4,48	2.837.365	1,95
	91.384.080	93,02	140.841.520	97,09
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	761.197	0,77	544.915	0,38

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	31. Dezember 2022	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:		
US-Dollar	7.708.197	4,87
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:		
Euro	40.133.656	25,33
US-Dollar	95.972.503	60,58
	136.106.159	85,91
	143.814.356	90,78
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	2.895.404	1,83

Systematic Global Sustainable Value	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Australischer Dollar	1.063.750	2,21	323.958	1,55
Brasilianischer Real	260.528	0,54	–	–
Kanadischer Dollar	1.782.255	3,71	606.525	2,91
Dänische Krone	259.180	0,54	119.757	0,57
Euro	4.046.608	8,42	1.683.294	8,04

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Systematic Global Sustainable Value (Fortsetzung)	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung):				
Hongkong-Dollar	1.631.434	3,40	202.444	0,97
Indonesische Rupiah	291.610	0,61	–	–
Israelischer Schekel	–	–	51.297	0,25
Japanischer Yen	2.696.878	5,62	1.155.675	5,53
Mexikanischer Peso	180.675	0,38	–	–
Neuer taiwanesischer Dollar	796.265	1,66	221.896	1,06
Neuseeländischer Dollar	63.031	0,13	–	–
Norwegische Krone	57.477	0,12	58.786	0,28
Britisches Pfund	2.087.872	4,35	795.563	3,81
Singapur-Dollar	–	–	17.936	0,09
Südafrikanischer Rand	370.092	0,77	–	–
Südkoreanischer Won	880.568	1,83	231.373	1,11
Schwedische Krone	383.756	0,80	197.339	0,95
Schweizer Franken	1.186.730	2,47	525.181	2,52
US-Dollar	28.921.680	60,23	12.643.935	60,52
	46.960.389	97,79	18.834.959	90,16
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	–	–	1.618.552	7,75
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
Australischer Dollar	133.123	0,28	83.096	0,40
Euro	101.504	0,21	–	–
Britisches Pfund	108.028	0,22	–	–
US-Dollar	412.782	0,86	264.102	1,27
	755.437	1,57	347.198	1,67
	47.715.826	99,36	20.800.709	99,58
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	34.856	0,07	(10.597)	(0,05)

Ultra Short Term Euro Bond

	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	72.343.961	8,81	146.158.777	12,59
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	670.503.994	81,63	818.744.378	70,54
Britisches Pfund	–	–	10.058.218	0,87
	670.503.994	81,63	828.802.596	71,41
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	56.450.113	6,87	62.415.148	5,38
	799.298.068	97,31	1.037.376.521	89,38
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(925.722)	(0,12)	1.155.799	0,09

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	Marktwert US\$	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	26.126.967	0,84	2.951.714	0,11
Britisches Pfund	3.685.493	0,12	–	–
US-Dollar	131.574.600	4,20	116.915.895	4,54
	161.387.060	5,16	119.867.609	4,65
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Euro	1.951.285	0,07	2.057.423	0,08
Hongkong-Dollar	–	–	5.931	0,00
Japanischer Yen	694.532	0,02	464.958	0,02
Britisches Pfund	–	–	5.274.707	0,20
US-Dollar	132.722.211	4,23	8.707.692	0,34
	135.368.028	4,32	16.510.711	0,64
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	4.218.750	0,13	11.177.787	0,44
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Euro	–	–	10.302.696	0,40
Für den Handel gehaltene Participatory Notes:				
Euro	6.404	0,00	12.737	0,00
Britisches Pfund	15.036	0,00	–	–
	21.440	0,00		
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	1.582.793.462	50,57	859.959.488	33,35
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	4.976.282	0,16	–	–
	1.888.765.022	60,34	1.017.831.028	39,48
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	177.192.829	5,66	(120.806.793)	(4,69)

XXXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

	31. Dezember 2022	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:		
US-Dollar	16.089.324	2,26
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:		
US-Dollar	3.946.436	0,55
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:		
US-Dollar	449.200.010	63,10
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:		
Euro	5.556.545	0,78
Britisches Pfund	921.374	0,13
US-Dollar	6.743.516	0,95
	13.221.435	1,86
	482.457.205	67,77
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	56.910.001	7,99

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

US Equity	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	27.005.260	85,83	8.236.976	92,22
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	478.769	1,52	141.214	1,58
	27.484.029	87,35	8.378.190	93,80
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.611.149	5,12	–	–
<b>US Equity Index PutWrite</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	632.264.076	92,92	392.089.074	82,53
	632.264.076	92,92	392.089.074	82,53
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	2.309.131	0,34	(2.749.847)	(0,58)
<b>US Large Cap Value<sup>2</sup></b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	1.688.625.847	95,51	2.024.667	98,97
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	–	–	19.361	0,95
	1.688.625.847	95,51	2.044.028	99,92
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	871.125	0,05	–	–
<b>US Long Short Equity</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	8.400.448	3,79	5.922.382	1,25
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Euro	1.265.964	0,57	–	–
US-Dollar	156.744.366	70,76	407.697.481	86,01
	158.010.330	71,33	407.697.481	86,01
Für den Handel gehaltene Participatory Notes:				
US-Dollar	3.750	0,00	9.330	0,00
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	1.744.930	0,79	3.613.606	0,76
	168.159.458	75,91	417.242.799	88,02
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	8.094.369	3,66	(18.190.468)	(3,83)

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

US Multi Cap Opportunities	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	439.025.865	99,48	781.762.992	100,07
	439.025.865	99,48	781.762.992	100,07
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	2.148.740	0,49	(614.771)	(0,08)
<b>US Real Estate Securities</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	–	–	16.391.963	1,60
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	624.531.489	96,38	998.183.643	97,64
	624.531.489	96,38	1.014.575.606	99,24
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	2.859.608	0,44	(2.989.092)	(0,29)
<b>US Small Cap</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Britisches Pfund	–	–	3.298.630	0,40
US-Dollar	578.779.674	97,70	808.712.718	98,37
	578.779.674	97,70	812.011.348	98,77
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	712.758	0,12	(461.426)	(0,06)
<b>US Small Cap Intrinsic Value</b>				
	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens	Marktwert US\$	% des Netto- vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	–	–	22.652	0,02
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	184.718.734	95,19	141.240.874	91,93
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	2.170.638	1,12	1.318.782	0,86
	186.889.372	96,31	142.582.308	92,81

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Portfolios wird in der Basiswährung des betreffenden Portfolios berechnet. Anlagen, die für Rechnung des Portfolios gehalten werden, können jedoch in anderen Währungen erworben werden. Der Wert der Basiswährung der Anlagen eines auf eine andere Währung lautenden Portfolios kann aufgrund von Währungsschwankungen in Bezug auf die jeweiligen Währungen steigen oder fallen. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Positionen werden täglich überwacht, und es werden Absicherungsstrategien zur Sicherstellung eingesetzt, dass die Positionen innerhalb festgelegter Limits bleiben.

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 hätten bei einem Anstieg der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber allen Währungen um 5 % und bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderung des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt (abgenommen)/zugenommen.

Portfolio	Währung	31. Dezember 2022	% des Nettovermögens	31. Dezember 2021	% des Nettovermögens
5G Connectivity	USD	16.196.327	1,63 %	43.092.894	1,80 %
Absolute Return Multi Strategy*	USD	-	-	627	-
Asian Debt – Hard Currency	USD	32.863	0,15 %	23.400	0,16 %
China A-Share Equity	CNY	766.150	4,72 %	1.183.156	4,84 %
China Bond	CNY	5.708.838	1,26 %	3.402.401	0,59 %
China Equity	USD	15.222.965	4,80 %	25.736.853	4,86 %
CLO Income	USD	611.238	0,44 %	215.980	0,14 %
Commodities <sup>2</sup>	USD	59.977	0,07 %	-	-
Corporate Hybrid Bond	EUR	35.490.162	1,99 %	47.461.637	1,93 %
Diversified Currency*	USD	-	-	(9)	-
Emerging Market Debt – Hard Currency	USD	22.052.213	0,89 %	26.531.696	0,73 %
Emerging Market Debt – Local Currency	USD	63.850.053	4,61 %	92.714.823	4,41 %
Emerging Market Debt Blend	USD	12.004.568	2,55 %	21.673.879	2,29 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	1.470.659	2,71 %	1.097.095	2,32 %
Emerging Markets Equity	USD	8.346.156	4,35 %	14.969.405	3,85 %
Emerging Markets Select Equity	USD	3.972.405	4,24 %	5.005.328	3,99 %
Euro Bond Absolute Return	EUR	685.901	1,41 %	59.182	0,11 %
Euro Opportunistic Bond	EUR	(572)	(0,01 %)	(562)	(0,01 %)
European High Yield Bond	EUR	151.849	0,47 %	346.274	0,89 %
European Sustainable Equity <sup>1</sup>	EUR	4.591.665	2,61 %	3.528.193	3,10 %
Event Driven <sup>2</sup>	USD	45.069	0,11 %	-	-
Global Bond	USD	2.992.478	2,22 %	4.377.115	2,43 %
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	26.179	0,02 %	(2.669)	(0,00 %)
Global Equity Megatrends	USD	470.294	0,59 %	392.652	0,47 %
Global Equity Index PutWrite*	USD	-	-	(1.252)	-
Global Flexible Credit Income	USD	4.319.726	1,09 %	5.104.127	0,72 %
Global High Yield SDG Engagement	USD	2.865.536	0,85 %	434.888	1,10 %
Global High Yield Sustainable Action	USD	211.087	1,40 %	203.135	1,15 %
Global Investment Grade Credit <sup>1</sup>	USD	1.170.010	1,36 %	1.523.437	1,54 %
Global Opportunistic Bond	USD	2.273.392	2,99 %	2.909.919	3,09 %
Global Real Estate Securities	USD	850.597	2,18 %	1.025.414	2,02 %
Global Sustainable Equity <sup>1</sup>	USD	1.772.787	1,35 %	3.307.082	1,62 %
High Yield Bond	USD	3.112.894	0,14 %	801.699	0,03 %
InnovAsia 5G <sup>1</sup>	USD	638.402	4,33 %	1.118.632	4,17 %
Japan Equity Engagement	JPY	(8.146.918)	(0,04 %)	26.340	0,00 %
Macro Opportunities FX	EUR	(39.764)	(0,13 %)	(56.718)	(0,13 %)
Multi-Asset Income	USD	182.057	1,60 %	375.541	1,65 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio	Währung	31. Dezember 2022	% des Nettovermögens	31. Dezember 2021	% des Nettovermögens
Multi-Style Premia*	USD	-	-	1	-
Next Generation Mobility	USD	971.244	0,66 %	1.619.880	0,73 %
Next Generation Space Economy <sup>2</sup>	USD	125.136	1,47 %	-	-
Short Duration Emerging Market Debt	USD	16.156.419	0,32 %	11.622.887	0,17 %
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	1.001.077	0,18 %	(10.977)	(0,00 %)
Strategic Income	USD	3.809.057	0,29 %	5.427.102	0,38 %
Sustainable Asia High Yield <sup>1</sup>	USD	12.741	0,04 %	-	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	38.780	0,04 %	87.627	0,06 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>2</sup>	USD	2.325.609	1,47 %	-	-
Systematic Global Sustainable Value	USD	921.286	1,92 %	313.271	1,50 %
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	(314.975)	(0,04 %)	552.336	0,05 %
Uncorrelated Strategies	USD	7.030.682	0,22 %	5.919.411	0,23 %
XXXXXXXXXXXX <sup>2</sup>	USD	3.480.578	0,49 %	-	-
US Equity	USD	80.558	0,26 %	-	-
US Equity Index PutWrite	USD	785.232	0,12 %	110.730	0,02 %
US Large Cap Value <sup>1</sup>	USD	79.926	0,00 %	-	-
US Long Short Equity	USD	338.890	0,15 %	(168.582)	(0,04 %)
US Multi Cap Opportunities	USD	106.892	0,02 %	(60.597)	(0,01 %)
US Real Estate Securities	USD	137.254	0,02 %	(240.066)	(0,02 %)
US Small Cap	USD	39.073	0,01 %	156.258	0,02 %
US Small Cap Intrinsic Value	USD	10.357	0,01 %	4.827	0,00 %

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

\* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

Eine Abschwächung der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber den oben genannten Währungen um 5 % hätte bei Konstanz aller anderen Variablen auf die oben aufgeführten Beträge im Jahresabschluss den entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt. Das Währungsrisiko wurde auf Basis des Nettovermögens des Portfolios berechnet, das auf eine andere Währung als die Basiswährung des betreffenden Portfolios lautet. Der Manager hält 5 % für einen angemessenen Satz für Wechselkurseffekte.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

In den nachstehenden Tabellen sind die Preisrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

	5G Connectivity		Absolute Return Multi Strategy*		Asian Debt - Hard Currency	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Australischer Dollar	479.859	(463.225)	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	-	-	-	44	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	76.194	-	-	2.211	2.403
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	88.434.633	121.713.279	-	-	37	27
Euro	68.866.568	116.616.359	-	10.175	650.316	455.039
Hongkong-Dollar	16.645.530	48.458.176	-	-	-	-
Indische Rupie	-	-	-	-	-	3.133
Indonesische Rupiah	-	-	-	-	237	(3.404)
Japanischer Yen	92.855.666	200.555.955	-	-	-	-
Malaysischer Ringgit	-	-	-	-	6.219	(3)
Neuer taiwanesischer Dollar	46.686.340	233.084.389	-	-	(9.958)	1.388
Norwegische Krone	-	-	-	1.000	-	-
Philippinischer Peso	-	-	-	-	-	3.586
Britisches Pfund	769.130	(200.219)	-	(24)	-	-
Singapur-Dollar	1.578.903	290.945	-	-	1.046	(8)
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	7.609.911	141.726.028	-	-	3.527	6.077
Schweizer Franken	-	-	-	1.343	-	-
Thailändischer Baht	-	-	-	-	3.627	343
US-Dollar	669.083.653	1.533.663.760	-	(12.538)	20.968.947	13.961.517
Vietnamesischer Dong	-	-	-	-	-	(578)
	<b>993.010.193</b>	<b>2.395.521.641</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>21.626.209</b>	<b>14.429.520</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	China A-Share Equity		China Bond		China Equity	
	Zum 31. Dezember 2022 CNY	Zum 31. Dezember 2021 CNY	Zum 31. Dezember 2022 CNY	Zum 31. Dezember 2021 CNY	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Chinesischer Yuan Renminbi	918.751	764.847	338.866.827	-	3.234.457	11.630.052
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	14.345.263	22.025.874	-	512.705.641	128.939.869	209.868.777
Euro	-	-	1.833	(143.541)	180.591	(92.073)
Hongkong-Dollar	977.264	1.637.237	-	-	172.004.521	293.309.225
Britisches Pfund	-	-	(3.579)	3.532	870	(1.848)
Singapur-Dollar	-	-	194	(3.185.003)	81.549	13.389
Schweizer Franken	-	-	-	-	17.439	9.535
US-Dollar	480	-	114.178.304	71.373.029	12.954.380	14.604.134
	<b>16.241.758</b>	<b>24.427.958</b>	<b>453.043.579</b>	<b>580.753.658</b>	<b>317.413.676</b>	<b>529.341.191</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	CLO Income		Commodities <sup>1</sup>		Corporate Hybrid Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR	EUR
Australischer Dollar	-	-	-	-	(84.871)	3.592
Euro	10.342.101	5.573.767	-	-	1.072.351.561	1.509.179.240
Britisches Pfund	1.747.984	(194.445)	1.199.530	-	383.674.609	428.655.307
Singapur-Dollar	-	-	-	-	(11.783)	37.144
Schwedische Krone	134.665	(1.059.713)	-	-	-	-
Schweizer Franken	-	-	-	-	(429.363)	2.002.776
US-Dollar	125.812.714	145.519.823	84.797.899	-	326.654.655	518.533.916
	<b>138.037.464</b>	<b>149.839.432</b>	<b>85.997.429</b>	<b>-</b>	<b>1.782.154.808</b>	<b>2.458.411.975</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Diversified Currency*		Emerging Market Debt - Hard Currency		Emerging Market Debt - Local Currency	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Argentinischer Peso	-	-	-	-	8.677	14.011
Australischer Dollar	-	-	172.417	382.851	253.560	464.286
Brasilianischer Real	-	-	-	-	(18.304.450)	(14.281.184)
Kanadischer Dollar	-	46	-	-	790	838
Chilenischer Peso	-	-	-	-	20.114.549	9.656.223
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	-	-	134.202.029	225.918.869
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	-	-	45.826	(154.549)
Kolumbianischer Peso	-	-	-	-	86.990.761	141.504.361
Tschechische Krone	-	-	-	-	72.788.675	77.554.961
Peso Dominikanische Republik	-	-	-	-	2.610.187	2.962.796
Ägyptisches Pfund	-	-	-	-	466.870	47.325.061
Euro	-	(233)	453.159.994	516.765.852	(1.258.427)	5.073.061
Ghanaischer Cedi	-	-	-	-	4.492.772	13.082.795
Hongkong-Dollar	-	-	1.272	(28)	-	-
Ungarischer Forint	-	-	-	-	(3.848.897)	49.337.182
Indische Rupie	-	-	-	-	-	45.985.907
Indonesische Rupiah	-	-	-	-	137.041.955	216.252.060
Israelischer Schekel	-	-	-	-	(843.671)	44.109.568
Japanischer Yen	-	-	360.169	(285.856)	32.421	42.063
Kasachischer Tenge	-	-	-	-	-	24.502.766
Malaysischer Ringgit	-	-	-	-	139.683.449	126.274.544
Mexikanischer Peso	-	-	-	-	142.845.938	163.326.810
Neuer taiwanesischer Dollar	-	-	-	-	(278.813)	220.439

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Diversified Currency* (Fortsetzung)		Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)		Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Neuseeländischer Dollar	-	3	-	-	-	-
Nigerianischer Naira	-	-	-	-	9.088	10.120
Peruanischer Sol	-	-	-	-	33.432.856	50.672.728
Philippinischer Peso	-	-	-	-	40.447	504.293
Polnischer Zloty	-	-	-	-	125.311.661	103.805.092
Britisches Pfund	-	-	(1.179.852)	2.189.286	(478.553)	(267.527)
Rumänischer Leu	-	-	-	-	56.063.139	57.200.537
Russischer Rubel	-	-	-	-	-	94.260.687
Serbischer Dinar	-	-	-	-	4.872.169	6.804.497
Singapur-Dollar	-	-	149.452	185.338	300.469	12.723
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	183.733.684	149.870.065
Südkoreanischer Won	-	-	-	-	(219.330)	1.491.932
Schwedische Krone	-	-	(13.719.192)	8.865.663	(3.511)	(5.698)
Schweizer Franken	-	-	2.100.001	2.530.819	-	-
Thailändischer Baht	-	-	-	-	125.999.885	172.349.821
Türkische Lira	-	-	-	-	18.221.312	15.656.043
Uganda-Schilling	-	-	-	-	7.308.984	13.754.708
US-Dollar	-	184	2.050.660.667	-	109.263.391	248.386.187
Uruguayischer Peso	-	-	-	-	2.636.726	2.611.921
Vietnamesischer Dong	-	-	-	-	-	(108.849)
Sambischer Kwacha	-	-	-	3.081.941.565	2.727.825	6.500.504
	-	-	<b>2.491.704.928</b>	<b>3.612.575.490</b>	<b>1.386.264.443</b>	<b>2.102.682.652</b>

\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt Blend		Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend		Emerging Markets Equity	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Argentinischer Peso	2.982	4.816	-	-	-	-
Australischer Dollar	46.451	28.272	104.537	190.859	64.457	(41.237)
Brasilianischer Real	(3.013.341)	(2.494.828)	-	-	7.586.762	8.714.329
Kanadischer Dollar	262	278	1	2	1.755.366	3.260.069
Chilenischer Peso	1.065.106	1.368.260	339.178	183.254	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	15.810.305	50.333.145	2.031.464	2.028.714	30.079	56
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	18.949	(47.761)	748	(611)	22.323.932	43.642.733
Kolumbianischer Peso	16.810.382	33.866.784	831.596	776.078	-	-
Tschechische Krone	11.496.050	19.019.314	869.272	539.621	-	-
Peso Dominikanische Republik	624.770	709.170	-	-	-	-
Ägyptisches Pfund	82.365	9.945.896	-	-	-	-
Euro	24.578.138	25.811.231	13.937.885	8.681.559	137.273	1.393.396
Ghanaischer Cedi	936.601	2.723.809	-	-	-	-
Hongkong-Dollar	-	-	-	-	37.056.247	72.414.275
Ungarischer Forint	(1.926.397)	6.731.515	124.597	291.659	2.147.618	6.783.162
Indische Rupie	-	12.904.012	-	2.466	32.037.144	62.492.207
Indonesische Rupiah	22.589.671	43.019.526	2.268.124	1.755.654	2.888.935	2.967.516
Israelischer Schekel	(136.238)	9.463.586	(10.118)	1.363.067	-	-
Kasachischer Tenge	-	5.319.650	-	133.691	-	-
Malaysischer Ringgit	22.805.460	29.629.003	2.125.633	1.040.704	-	-
Mexikanischer Peso	23.413.075	33.756.292	2.639.163	1.619.090	2.869.765	2.171.160
Neuer taiwanesischer Dollar	(48.237)	45.584	(2.682)	1.200	11.838.081	23.064.114
Nigerianischer Naira	2.843	3.166	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)		Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)		Emerging Markets Equity (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Norwegische Krone	150	329	193.954	194.927	-	-
Peruanischer Sol	7.753.772	12.069.350	287.425	294.216	-	-
Philippinischer Peso	6.772	106.750	550	3.295	-	-
Polnischer Zloty	32.614.821	26.500.843	1.317.294	772.896	2.615.812	6.975.686
Britisches Pfund	(167.874)	1.207.001	(3)	(4)	4.164.338	7.782.194
Katar-Rial	-	-	-	-	1.894.532	-
Rumänischer Leu	8.884.562	10.519.337	719.940	265.463	-	-
Russischer Rubel	-	15.415.580	-	605.001	3.617	529.727
Saudi-Riyal	-	-	-	-	6.654.852	2.161.224
Serbischer Dinar	873.537	1.565.756	-	-	-	-
Singapur-Dollar	197.329	21.409	790	-	2	1.161.207
Südafrikanischer Rand	28.878.918	33.423.231	-	-	6.019.825	9.110.882
Südkoreanischer Won	47.856	349.826	5.962	14.397	21.091.276	42.197.135
Schwedische Krone	(863)	(13.617)	-	-	-	-
Schweizer Franken	25	26	-	-	-	-
Thailändischer Baht	20.526.474	42.330.238	1.609.126	1.166.141	992.701	2.608.267
Türkische Lira	3.192.431	3.214.909	-	-	-	-
Uganda-Schilling	1.090.702	2.607.840	-	-	-	-
VAE-Dirham	-	-	-	-	2.750.497	-
US-Dollar	230.090.129	514.103.871	24.861.201	25.444.372	24.884.644	89.302.323
Uruguayischer Peso	600.568	594.919	18.744	18.568	-	-
Vietnamesischer Dong	-	(20.019)	-	-	-	-
Sambischer Kwacha	432.974	1.443.145	-	-	-	-
	<b>470.181.480</b>	<b>947.581.444</b>	<b>54.274.381</b>	<b>47.386.279</b>	<b>191.807.755</b>	<b>388.690.425</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Emerging Markets Select Equity		Euro Bond Absolute Return		Euro Opportunistic Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	EUR	EUR	EUR	EUR
Brasilianischer Real	2.794.924	2.825.725	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	7	5	(21.682)	10.419	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	70.634	56.624	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	9.438.596	14.177.796	-	-	-	-
Dänische Krone	-	-	995.379	626.533	-	-
Euro	16.195	672.155	34.809.856	52.981.204	9.306.187	11.222.574
Hongkong-Dollar	19.787.831	23.939.397	-	-	-	-
Ungarischer Forint	-	1.408.888	-	-	-	-
Indische Rupie	7.573.691	10.388.920	-	-	-	-
Indonesische Rupiah	2.132.626	1.231.782	-	-	-	-
Japanischer Yen	-	-	7.513	-	-	-
Mexikanischer Peso	1.624.815	694.142	-	-	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	13.804.257	18.926.584	-	-	-	-
Polnischer Zloty	1.515.263	2.529.258	-	-	-	-
Britisches Pfund	1.390.901	1.617.161	(33.597)	(17.428)	(9.957)	(10.520)
Katar-Rial	1.034.075	-	-	-	-	-
Russischer Rubel	-	116.276	-	-	-	-
Saudi-Riyal	1.405.056	739.943	-	-	-	-
Singapur-Dollar	1	535.148	-	-	-	-
Südafrikanischer Rand	3.006.541	2.099.350	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	11.734.068	17.318.184	-	-	-	-
Thailändischer Baht	756.239	829.213	-	-	-	-
VAE-Dirham	1.362.386	-	-	-	-	-
US-Dollar	14.314.016	25.249.718	12.770.407	564.117	(1.488)	(718)
	<b>93.762.122</b>	<b>125.356.269</b>	<b>48.527.876</b>	<b>54.164.845</b>	<b>9.294.742</b>	<b>11.211.336</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	European High Yield Bond		European Sustainable Equity <sup>2</sup>		Event Driven <sup>1</sup>	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	EUR	EUR	EUR	EUR	US\$	US\$
Dänische Krone	-	-	8.595.903	4.453.917	-	-
Euro	29.417.545	31.939.835	84.020.928	43.322.225	-	-
Norwegische Krone	-	-	7.133.296	3.185.720	-	-
Britisches Pfund	4.651.454	6.087.947	24.378.899	18.271.015	901.385	-
Singapur-Dollar	(669)	1.053	-	-	-	-
Schwedische Krone	-	-	13.773.626	6.167.199	-	-
Schweizer Franken	-	-	34.936.391	16.492.898	-	-
US-Dollar	(1.613.802)	836.476	3.015.187	21.993.101	40.545.287	-
	<b>32.454.528</b>	<b>38.865.311</b>	<b>175.854.230</b>	<b>113.886.075</b>	<b>41.446.672</b>	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Bond		Global Diversified Income FMP – 2024		Global Equity Index PutWrite*	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Australischer Dollar	(76.731)	2.137.677	-	-	-	-
Brasilianischer Real	1.366	1.084	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	12.580.352	16.152.439	-	-	-	-
Chilenischer Peso	6.401	-	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	360.970	165.174	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	(8.276)	-	-	-	-	-
Kolumbianischer Peso	(3.588)	(17.197)	-	-	-	-
Tschechische Krone	(37.717)	(4.776)	-	-	-	-
Dänische Krone	22.251	(5.886)	-	-	-	-
Euro	21.955.385	34.532.526	163.266	(52.326)	-	(2.055)
Hongkong-Dollar	15.864	28.573	3.914	(2.202)	-	-
Ungarischer Forint	15.703	(4.777)	-	-	-	-
Indonesische Rupiah	1.151.870	5.596	-	-	-	-
Israelischer Schekel	(1.874)	8.679	-	-	-	-
Japanischer Yen	7.135.466	17.736.095	-	-	-	-
Malaysischer Ringgit	28.441	2.707	-	-	-	-
Mexikanischer Peso	2.869.583	14.281	-	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	1.566.178	3.352.260	-	-	-	-
Norwegische Krone	(14.416)	(11.214)	-	-	-	-
Peruanischer Sol	6.187	3.433	-	-	-	-
Polnischer Zloty	33.154	268.690	-	-	-	-
Britisches Pfund	6.752.292	13.418.430	148.036	(21.444)	-	55
Russischer Rubel	-	(10.928)	-	-	-	-
Singapur-Dollar	19.850	2.085	208.355	22.599	-	1

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Bond (Fortsetzung)		Global Diversified Income FMP – 2024 Bond (Fortsetzung)		Global Equity Index PutWrite* (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Südafrikanischer Rand	4.487	(4.669)	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	5.264.565	14.037	-	-	-	-
Schwedische Krone	104.449	(180.996)	-	-	-	-
Schweizer Franken	70.850	(62.468)	-	-	-	(23.047)
Thailändischer Baht	26.583	751	-	-	-	-
Türkische Lira	(95)	702	-	-	-	-
US-Dollar	74.961.746	92.855.070	159.872.515	233.800.782	-	25.046
	<b>134.811.296</b>	<b>180.397.378</b>	<b>160.396.086</b>	<b>233.747.409</b>	-	-

\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Equity Megatrends		Global Flexible Credit Income		Global High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Australischer Dollar	-	-	-	-	1.177	-
Kanadischer Dollar	4.945.156	3.713.058	78.451	(161.138)	-	-
Euro	8.867	23.987	51.658.875	88.144.727	48.374.732	7.105.290
Britisches Pfund	4.451.862	4.115.988	34.657.200	14.098.955	7.112.241	1.592.462
Schweizer Franken	-	-	-	-	1.822.577	-
US-Dollar	69.938.480	75.300.816	308.131.803	603.130.240	279.642.651	30.929.597
	<b>79.344.365</b>	<b>83.153.849</b>	<b>394.526.329</b>	<b>705.212.784</b>	<b>336.953.378</b>	<b>39.627.349</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global High Yield Sustainable Action		Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>		Global Opportunistic Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Australischer Dollar	-	-	-	-	123.667	472.368
Brasilianischer Real	-	-	-	-	16.533	18.369
Kanadischer Dollar	-	-	2.208.763	-	(273.916)	1.385.129
Chilenischer Peso	-	-	-	-	11.491	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	-	-	3.467.949	4.740.305
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	-	-	(13)	(88)
Tschechische Krone	-	-	-	-	299.742	476.818
Euro	3.481.434	3.123.503	17.356.141	24.952.793	31.829.021	40.321.336
Ungarischer Forint	-	-	-	-	9	(267)
Indonesische Rupiah	-	-	-	-	330.337	-
Japanischer Yen	-	-	-	-	(92.504)	155.718
Mexikanischer Peso	-	-	-	-	1.478.309	4.216
Neuseeländischer Dollar	-	-	-	-	3.477.029	3.149.059
Norwegische Krone	-	-	-	-	(43.838)	(12.280)
Polnischer Zloty	-	-	-	-	271.645	463.145
Britisches Pfund	740.307	939.204	3.835.303	5.515.951	4.282.014	7.140.895
Russischer Rubel	-	-	-	-	2.082	(10.807)
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	18.875	15.639
Südkoreanischer Won	-	-	-	-	(5.485)	(2)
Schwedische Krone	-	-	-	-	17.291	(3.181)
Schweizer Franken	-	-	-	-	6.201	(119.029)
Thailändischer Baht	-	-	-	-	251.550	-
Türkische Lira	-	-	-	-	(143)	1.039
US-Dollar	10.825.327	13.537.846	62.508.435	68.341.458	30.637.597	36.046.449
	<b>15.047.068</b>	<b>17.600.553</b>	<b>85.908.642</b>	<b>98.810.202</b>	<b>76.105.443</b>	<b>94.244.831</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Real Estate Securities		Global Sustainable Equity <sup>2</sup>		High Yield Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Australischer Dollar	1.286.976	1.938.291	-	1.978.880	4.321.856	(2.778.524)
Kanadischer Dollar	1.815.491	2.241.390	-	-	70.793	(114.980)
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	-	-	42.580	124.444
Dänische Krone			2.087.276	3.461.375	-	-
Euro	2.647.086	1.963.616	13.587.115	23.832.303	12.183.833	(5.982.090)
Hongkong-Dollar	3.067.701	1.927.566	-	-	22.474	(14.492)
Japanischer Yen	3.606.589	4.841.840	1.579.691	2.273.533	-	-
Norwegische Krone	-	-	4.295.279	5.772.610	-	-
Britisches Pfund	3.087.877	6.229.668	4.182.652	15.571.177	37.568.566	36.059.233
Singapur-Dollar	1.500.210	1.365.906	-	-	1.099.758	143.912
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	6.026.874	(11.176.065)
Schwedische Krone	-	-	3.754.629	2.712.385	320.183	(395.591)
Schweizer Franken	-	-	5.969.094	10.539.379	600.966	168.139
US-Dollar	22.010.490	30.379.294	96.122.463	137.844.938	2.236.493.829	3.187.321.487
Vietnamesischer Dong	-	-	-	-	-	-
	<b>39.022.420</b>	<b>50.887.571</b>	<b>131.578.199</b>	<b>203.986.580</b>	<b>2.298.751.712</b>	<b>3.203.355.473</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	InnovAsia 5G <sup>2</sup>		Japan Equity Engagement		Macro Opportunities FX	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	JPY	JPY	EUR	EUR
Australischer Dollar	-	-	-	-	32.782	89.327
Brasilianischer Real	-	-	-	-	(82.316)	2.330
Kanadischer Dollar	2.183.240	932.486	-	-	135.641	(6.956)
Chilenischer Peso	-	-	-	-	24.906	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	-	-	5	-
Tschechische Krone	-	-	-	-	(63.164)	(29.979)
Euro	302.164	487.963	(161.821.291)	-	32.305.444	45.744.245
Hongkong-Dollar	212.641	-	-	-	-	-
Ungarischer Forint	-	-	-	-	9	(779)
Indische Rupie	539.135	1.817.216	-	-	-	-
Japanischer Yen	3.906.632	4.330.218	20.705.605.935	12.105.410.851	37.140	(6.128)
Malaysischer Ringgit	319.895	454.056	-	-	-	-
Mexikanischer Peso	-	-	-	-	(85.167)	22.965
Neuer taiwanesischer Dollar	3.817.484	9.788.574	-	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	-	-	-	-	303.668	(73.732)
Norwegische Krone	-	-	-	-	34.363	(16.613)
Polnischer Zloty	-	-	-	-	5	(134)
Britisches Pfund	-	-	(1.117.058)	526.793	173.711	41.099
Russischer Rubel	-	-	-	-	-	(40.411)
Singapur-Dollar	551.007	1.402.130	-	-	-	-
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	(2.834)	(9.195)
Südkoreanischer Won	515.684	3.117.264	-	-	(17.087)	(55)
Schwedische Krone	-	-	-	-	(594.217)	(452.382)
Schweizer Franken	26.843	42.738	-	-	64.744	(551.994)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	InnovAsia 5G <sup>2</sup> (Fortsetzung)		Japan Equity Engagement (Fortsetzung)		Macro Opportunities FX (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	JPY	JPY	EUR	EUR
Türkische Lira	-	-	-	-	43	1.986
US-Dollar	1.980.961	4.422.342	(1)	-	(757.520)	(103.703)
Vietnamesischer Dong	393.307	-	-	-	-	-
	<b>14.748.993</b>	<b>26.794.987</b>	<b>20.542.667.585</b>	<b>12.105.937.644</b>	<b>31.510.156</b>	<b>44.609.891</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Multi-Asset Income		Multi-Style Premia*		Next Generation Mobility	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Australischer Dollar	46.449	138.481	-	1	2	2
Brasilianischer Real	18.289	57.287	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	(3.708)	6.956	-	-	2.312.662	4.254.965
Chilenischer Peso	1.288	-	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	18.884	-	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	(5.958)	-	-	-	1.537.306	575.180
Tschechische Krone	(9.292)	(1.301)	-	-	-	-
Dänische Krone	-	7.129	-	-	-	-
Euro	2.880.701	5.158.521	-	14	5.955.204	11.034.636
Hongkong-Dollar	99.369	381.681	-	-	3.880.770	5.890.429
Ungarischer Forint	1	(32)	-	-	-	-
Israelischer Scheckel	-	12.574	-	-	-	-
Japanischer Yen	163.447	321.024	-	-	2.867.915	4.994.303
Mexikanischer Peso	1.396	776	-	-	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	23.212	202.249	-	-	1.016.740	2.917.848
Neuseeländischer Dollar	15.785	(825)	-	-	-	-
Norwegische Krone	(4.986)	10.769	-	-	-	-
Polnischer Zloty	1	43	-	-	-	-
Britisches Pfund	302.903	799.604	-	(1)	2	3
Russischer Rubel	-	(781)	-	-	-	-
Singapur-Dollar	2	16.696	-	-	1	1
Südafrikanischer Rand	10.952	11	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	31.143	150.669	-	-	-	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Multi-Asset Income (Fortsetzung)		Multi-Style Premia* (Fortsetzung)		Next Generation Mobility (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Schwedische Krone	4.448	50.625	-	-	1.854.268	2.730.237
Schweizer Franken	46.820	198.568	-	-	-	-
Türkische Lira	(15)	100	-	-	-	-
US-Dollar	7.724.984	15.194.527	-	(14)	128.579.807	188.085.712
	<b>11.366.115</b>	<b>22.705.351</b>	-	-	<b>148.004.677</b>	<b>220.483.316</b>

\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Next Generation Space Economy <sup>1</sup>		Short Duration Emerging Market Debt		Short Duration High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Australischer Dollar	-	-	18.635	32.955	49.208	(4.707)
Kanadischer Dollar	-	-	21.567	32.817	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	35	38	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	103.745	-	-	-	6.127	7.156
Euro	1.198.609	-	316.112.981	239.266.589	4.043.064	(768.304)
Hongkong-Dollar	-	-	-	-	1.251	-
Japanischer Yen	172.026	-	20.830.836	(24.512.505)	11.907.484	(2.294.883)
Neuer taiwanesischer Dollar	134.550	-	-	-	-	-
Britisches Pfund	334.851	-	(13.828.802)	16.004.886	3.863.852	2.813.010
Singapur-Dollar	270.259	-	1.448.291	697.515	92.456	17.917
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	401	410
Südkoreanischer Won	288.684	-	-	-	-	-
Schwedische Krone	-	-	(5.841)	(20.681)	-	-
Schweizer Franken	-	-	(1.469.320)	956.121	57.702	9.867
US-Dollar	5.988.138	-	4.801.533.368	6.701.996.360	536.352.134	644.659.444
	<b>8.490.862</b>	-	<b>5.124.661.750</b>	<b>6.934.454.095</b>	<b>556.373.679</b>	<b>644.439.910</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Strategic Income		Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>		Sustainable Emerging Market Corporate Debt	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Australischer Dollar	1.338.717	895.896	-	-	-	-
Brasilianischer Real	(401.123)	(193.283)	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	427.290	362.689	-	-	-	-
Chilenischer Peso	21.849	(21.609)	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	-	-	152.101	165.403
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	-	-	(713)	(651)
Kolumbianischer Peso	1.400.056	3.015.365	-	-	-	-
Tschechische Krone	20.373	(70)	-	-	-	-
Dänische Krone	-	(52)	-	-	-	-
Ägyptisches Pfund	-	65.562	-	-	-	-
Euro	28.762.204	72.320.484	241.129	-	425.989	1.239.806
Hongkong-Dollar	(2.375)	(5.882)	-	-	-	-
Ungarischer Forint	1.858.183	(5.048)	-	-	-	-
Indonesische Rupiah	3.590.638	5.586.714	-	-	-	-
Israelischer Schekel	(26.852)	-	-	-	-	-
Japanischer Yen	21.384.616	(3.808.426)	-	-	-	-
Kasachischer Tenge	-	(6.647)	-	-	-	-
Malaysischer Ringgit	11.371	-	-	-	-	-
Mexikanischer Peso	2.747.959	4.269.752	-	-	858	817
Neuer taiwanesischer Dollar	4.170	-	-	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	(59.525)	139	-	-	-	-
Norwegische Krone	4.975	6.183	-	-	-	-
Peruanischer Sol	4.521.028	36.087	-	-	-	-
Philippinischer Peso	-	14.208	-	-	-	-
Polnischer Zloty	25.574	(111.243)	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Strategic Income (Fortsetzung)		Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup> (Fortsetzung)		Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Britisches Pfund	3.531.816	15.265.631	13.686	-	(459)	2.930
Rumänischer Leu	2.050	(39.595)	-	-	-	-
Russischer Rubel	-	3.813.025	-	-	-	-
Singapur-Dollar	1.630.397	287.780	-	-	1	1
Südafrikanischer Rand	3.686.731	4.935.770	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	19.745	2.662	-	-	-	-
Schwedische Krone	-	-	-	-	(745)	44.629
Schweizer Franken	-	-	-	-	198.563	299.614
Thailändischer Baht	2.455	2.740	-	-	-	-
Türkische Lira	1.678.824	1.853.210	-	-	-	-
US-Dollar	1.246.624.709	1.336.379.481	31.667.456	24.721.277	97.468.713	143.304.876
	<b>1.322.805.855</b>	<b>1.444.921.523</b>	<b>31.922.271</b>	<b>24.721.277</b>	<b>98.244.308</b>	<b>145.057.425</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency <sup>1</sup>		Systematic Global Sustainable Value		Ultra Short Term Euro Bond	
	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2021
	US\$	US\$	US\$	US\$	EUR	EUR
Australischer Dollar	-	-	1.196.879	407.054	-	-
Brasilianischer Real	-	-	266.033	-	-	-
Kanadischer Dollar	-	-	1.784.244	607.066	-	-
Dänische Krone	-	-	259.300	119.757	-	-
Euro	46.512.189	-	4.183.597	1.672.741	827.689.558	1.149.623.823
Hongkong-Dollar	-	-	1.631.458	202.455	-	-
Indonesische Rupiah	-	-	291.610	-	-	-
Israelischer Schekel	-	-	-	51.297	-	-
Japanischer Yen	-	-	2.696.880	1.155.681	-	-
Mexikanischer Peso	-	-	180.675	-	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	-	-	796.265	221.896	-	-
Neuseeländischer Dollar	-	-	63.032	-	-	-
Norwegische Krone	-	-	57.495	58.788	-	-
Britisches Pfund	-	-	2.197.074	796.827	(7.637)	9.976.866
Singapur-Dollar	-	-	1	17.937	-	-
Südafrikanischer Rand	-	-	370.132	18	-	-
Südkoreanischer Won	-	-	880.568	231.373	-	-
Schwedische Krone	-	-	383.756	197.339	-	-
Schweizer Franken	-	-	1.186.729	525.181	(131.943)	64.601
US-Dollar	111.908.405	-	29.598.713	14.622.840	(6.159.911)	1.005.248
	<b>158.420.594</b>	-	<b>48.024.441</b>	<b>20.888.250</b>	<b>821.390.067</b>	<b>1.160.670.538</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Uncorrelated Strategies		XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>		US Equity	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Australischer Dollar	(15.921.904)	69.363.411	(1.220.926)	-	-	-
Brasilianischer Real	213.635	11.827	(15.408)	-	-	-
Kanadischer Dollar	(1.326.573)	1.502.856	(677.683)	-	-	-
Chilenischer Peso	569.854	175.329	26.136	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	6.864.978	(181.336)	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	(41.686.510)	70.560	58.578	-	-	-
Kolumbianischer Peso	(16.602)	(5.893)	(1.474)	-	-	-
Tschechische Krone	2.364.518	953.466	69	-	-	-
Dänische Krone	532.153	597.036	305.817	-	-	-
Ägyptisches Pfund	125.217	19.538.150	-	-	-	-
Euro	44.500.025	119.051	72.161.991	-	-	-
Hongkong-Dollar	(29.747.726)	(159.053)	(3.019.116)	-	-	-
Ungarischer Forint	(7.589.014)	199.502	(16.124)	-	-	-
Indische Rupie	(390.252)	(610.583)	2.039	-	-	-
Indonesische Rupiah	(174.498)	-	-	-	-	-
Israelischer Schekel	4.743.336	412.453	-	-	-	-
Japanischer Yen	22.469.382	(7.308.447)	2.579.962	-	1.611.150	-
Malaysischer Ringgit	6.589	(5.311)	(1.855)	-	-	-
Mexikanischer Peso	(846.328)	(650.614)	(1.358)	-	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	643.394	3.550.123	48.871	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	(1.144.140)	(449.663)	(40.543)	-	-	-
Norwegische Krone	(461.930)	3.056.216	(35.178)	-	-	-
Philippinischer Peso	(86.635)	(409.849)	-	-	-	-
Polnischer Zloty	(4.936.105)	17.702.892	(329)	-	-	-
Britisches Pfund	146.277.813	(4.370.520)	(3.452.419)	-	-	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)		XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup> (Fortsetzung)		US Equity (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Russischer Rubel	-	34.081	-	-	-	-
Singapur-Dollar	113.781	(752.537)	(1.979)	-	-	-
Südafrikanischer Rand	984.523	1.025.700	(65.216)	-	-	-
Südkoreanischer Won	21.742.052	13.197.590	2.255.903	-	-	-
Schwedische Krone	(2.850.273)	(2.447.305)	41.680	-	-	-
Schweizer Franken	(4.469.935)	2.082.188	676.154	-	-	-
Thailändischer Baht	(3.881)	(75.766)	-	-	-	-
Türkische Lira	114.691	2.222.660	3.966	-	-	-
US-Dollar	2.989.873.347	2.459.970.998	642.331.152	-	29.853.679	8.931.605
	<b>3.130.486.982</b>	<b>2.578.359.212</b>	<b>711.942.710</b>	-	<b>31.464.829</b>	<b>8.931.605</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	US Equity Index PutWrite		US Large Cap Value <sup>2</sup>		US Long Short Equity	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Euro	465.872	(42.362)	1.103.186	-	6.721.254	(3.357.013)
Britisches Pfund	15.230.653	2.254.962	495.336	-	43.281	(18.486)
Singapur-Dollar	8.116	1.992	-	-	13.246	3.846
Schweizer Franken	-	-	-	-	11	11
US-Dollar	664.752.097	472.862.543	1.766.355.837	2.045.700	214.752.109	477.392.418
	<b>680.456.738</b>	<b>475.077.135</b>	<b>1.767.954.359</b>	<b>2.045.700</b>	<b>221.529.901</b>	<b>474.020.776</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	US Multi Cap Opportunities		US Real Estate Securities		US Small Cap	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Australischer Dollar	92.774	(57.980)	709.236	(709.904)	136.215	(118.888)
Kanadischer Dollar	-	-	-	-	12.396	13.149
Euro	504.882	(221.852)	835.315	(1.564.325)	507.870	109.173
Hongkong-Dollar	-	-	43.005	(32.231)	-	-
Britisches Pfund	-	-	-	-	26.178	3.320.179
Singapur-Dollar	1.012.735	168.653	34.162	235.948	-	-
Südafrikanischer Rand	527.446	(1.100.755)	1.021.954	(2.782.564)	98.794	(198.450)
Schweizer Franken	-	-	101.404	51.757	-	-
US-Dollar	439.178.113	782.437.605	645.280.719	1.027.098.287	591.597.214	819.017.032
	<b>441.315.950</b>	<b>781.225.671</b>	<b>648.025.795</b>	<b>1.022.296.968</b>	<b>592.378.667</b>	<b>822.142.195</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	US Small Cap Intrinsic Value	
	Zum 31. Dezember 2022 US\$	Zum 31. Dezember 2021 US\$
Britisches Pfund	207.132	96.546
US-Dollar	193.833.908	153.525.880
	<b>194.041.040</b>	<b>153.622.426</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko

Die Portfolios können Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren halten. Jegliche Veränderung des Zinssatzes bestimmter Wertpapiere kann zu fallenden oder steigenden Erträgen führen. Die Kurse der gehaltenen Wertpapiere werden durch inländische Zinssätze beeinflusst. Die Performance des Portfolios wird daher teilweise von der Fähigkeit abhängig sein, solche Zinssatzschwankungen vorwegzunehmen. Die Manager und die Sub-Investment-Manager steuern dieses Risiko anhand von Analysen der Duration und der Renditekurve, um die Durationspositionierung und die Struktur der Renditekurve festzulegen und zu überwachen.

Die Gesellschaft hat im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 49 Portfolios. Bei achtzehn der Portfolios waren die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten überwiegend in Dividendenpapieren und nichtverzinslichen Wertpapieren angelegt. Infolgedessen sind diese Portfolios keinen größeren Risiken durch Fluktuationen des herrschenden Marktzinsniveaus ausgesetzt.

Zum Jahresende investierten die unten in der Tabelle aufgeführten Portfolios vor allem in festverzinsliche und variabel verzinsliche Instrumente und sind somit den Auswirkungen der Schwankungen der aktuellen Zinssätze auf ihre jeweilige Finanzposition und die Cashflows ausgesetzt.

Basierend auf der Zusammensetzung der Portfolios zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 hätten bei einem Rückgang der Zinssätze um 0,50 % bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderungen des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung ungefähr in dem Umfang zugenommen, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Ein Anstieg der Zinssätze um 0,50 % hätte einen entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt.

Portfolio	Währung	31. Dezember 2022	% des Nettovermögens	31. Dezember 2021	% des Nettovermögens
Asian Debt - Hard Currency	USD	457.101	2,11 %	286.768	1,99 %
China Bond	CNY	3.911.507	0,86 %	6.771.280	1,17 %
CLO Income	USD	299.108	0,22 %	319.860	0,21 %
Commodities <sup>1</sup>	USD	60.966	0,07 %	-	-
Corporate Hybrid Bond	EUR	25.225.221	1,42 %	37.133.157	1,51 %
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	80.254.944	3,22 %	130.273.889	3,61 %
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	37.789.578	2,73 %	50.116.654	2,38 %
Emerging Market Debt Blend	USD	12.264.416	2,61 %	23.907.713	2,52 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	1.782.765	3,28 %	1.736.229	3,66 %
Euro Bond Absolute Return	EUR	280.039	0,58 %	116.763	0,22 %
Euro Opportunistic Bond	EUR	236.325	2,54 %	259.026	2,31 %
European High Yield Bond	EUR	547.332	1,69 %	619.643	1,59 %
Global Bond	USD	3.834.658	2,84 %	5.921.335	3,28 %
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	902.467	0,56 %	2.004.988	0,86 %
Global Flexible Credit Income	USD	3.518.113	0,89 %	8.259.750	1,17 %
Global High Yield SDG Engagement	USD	5.562.582	1,65 %	720.378	1,82 %
Global High Yield Sustainable Action	USD	276.978	1,84 %	303.668	1,73 %
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	USD	2.526.643	2,94 %	3.553.978	3,60 %
Global Opportunistic Bond	USD	2.504.123	3,29 %	2.829.867	3,00 %
High Yield Bond	USD	43.177.996	1,88 %	54.947.831	1,72 %
Macro Opportunities FX	EUR	77.127	0,24 %	97.264	0,22 %
Multi-Asset Income	USD	153.665	1,35 %	155.405	0,68 %
Short Duration Emerging Market Debt	USD	51.673.561	1,01 %	79.371.139	1,14 %
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	6.681.961	1,20 %	4.619.986	0,72 %
Strategic Income	USD	34.630.321	2,62 %	21.985.804	1,52 %
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	USD	407.994	1,28 %	298.778	1,21 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	2.037.865	2,07 %	3.077.387	2,12 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	USD	5.249.224	3,31 %	-	-
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	5.435.227	0,66 %	5.394.358	0,46 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio (Fortsetzung)	Währung	31. Dezember 2022	% des Nettovermögens	31. Dezember 2021	% des Nettovermögens
Uncorrelated Strategies	USD	k/A	k/A	(9.513.769)	(0,37) %
US Equity Index PutWrite	USD	3.224.547	0,47 %	1.803.610	0,38 %
US Long Short Equity	USD	403.583	0,18 %	44.488	0,01 %

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

In den nachstehenden Tabellen sind die Zinsrisiken der betreffenden Portfolios zusammengefasst. Sie beinhalten die nicht-derivativen verzinslichen und unverzinslichen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Portfolios zu ihren jeweiligen beizulegenden Zeitwerten, klassifiziert nach Fälligkeitsterminen. Andere Beträge und Verbindlichkeiten unterliegen keinen Veränderungen von Zinssätzen.

Asian Debt - Hard Currency

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	524.835	6.412.192	13.244.028	–	20.181.055
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.180.261	–	–	–	1.180.261
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.705.096</b>	<b>6.412.192</b>	<b>13.244.028</b>	<b>–</b>	<b>21.361.316</b>

<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
---	---	---	---	---	---

<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	1.705.096	6.412.192	13.244.028	–	21.361.316
---	-----------	-----------	------------	---	------------

31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	181.892	4.662.405	9.212.974	–	14.057.271
Barmittel und Barmitteläquivalente	151.741	–	–	–	151.741
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>333.633</b>	<b>4.662.405</b>	<b>9.212.974</b>	<b>–</b>	<b>14.209.012</b>

<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
---	---	---	---	---	---

<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	333.633	4.662.405	9.212.974	–	14.209.012
---	---------	-----------	-----------	---	------------

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## China Bond

## 31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr CNY	1 - 5 Jahre CNY	Über 5 Jahre CNY	Unverzinslich CNY	Insgesamt CNY
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	139.734.420	234.837.039	50.592.395	–	425.163.854
Barmittel und Barmitteläquivalente	22.788.957	–	–	–	22.788.957
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	162.523.377	234.837.039	50.592.395	–	447.952.811
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	162.523.377	234.837.039	50.592.395	–	447.952.811

## 31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr CNY	1 - 5 Jahre CNY	Über 5 Jahre CNY	Unverzinslich CNY	Insgesamt CNY
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	75.520.856	394.136.435	74.220.598	–	543.877.889
Barmittel und Barmitteläquivalente	29.971.297	–	–	–	29.971.297
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	105.492.153	394.136.435	74.220.598	–	573.849.186
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	101.867.494	394.136.435	74.220.598	3.624.659	573.849.186

## CLO Income

## 31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	–	112.870.953	–	112.870.953
Barmittel und Barmitteläquivalente	20.349.795	–	–	–	20.349.795
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	20.349.795	–	112.870.953	–	133.220.748
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	20.349.795	–	112.870.953	–	133.220.748

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

CLO Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	2.508.003	130.766.946	–	133.274.949
Barmittel und Barmitteläquivalente	24.669.895	–	–	–	24.669.895
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	24.669.895	2.508.003	130.766.946	–	157.944.844
Kontenüberziehung	945	–	–	–	945
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	945	–	–	–	945
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	24.668.950	2.508.003	130.766.946	–	157.943.899

Commodities<sup>1</sup>

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	59.358.047	16.849.925	–	–	76.207.972
Barmittel und Barmitteläquivalente	8.094.998	–	–	–	8.094.998
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	67.453.045	16.849.925	–	–	84.302.970
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	67.453.045	16.849.925	–	–	84.302.970

Corporate Hybrid Bond

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr EUR	Über 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	–	1.648.318.515	–	1.648.318.515
Barmittel und Barmitteläquivalente	124.965.163	–	–	–	124.965.163
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	124.965.163	–	1.648.318.515	–	1.773.283.678
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	124.965.163	–	1.648.318.515	–	1.773.283.678

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	Über 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	2.250.494.338	–	11.305.839	2.261.800.177
Barmittel und Barmitteläquivalente	171.915.142	–	–	–	171.915.142
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>171.915.142</b>	<b>2.250.494.338</b>	<b>–</b>	<b>11.305.839</b>	<b>2.433.715.319</b>
Kontenüberziehung	81.862	–	–	–	81.862
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>81.862</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>81.862</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>171.833.280</b>	<b>2.250.494.338</b>	<b>–</b>	<b>11.305.839</b>	<b>2.433.633.457</b>

## Emerging Market Debt – Hard Currency

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	60.531.284	259.378.034	1.973.089.093	16.110.000	2.309.108.411
Barmittel und Barmitteläquivalente	107.924.157	–	–	–	107.924.157
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>168.455.441</b>	<b>259.378.034</b>	<b>1.973.089.093</b>	<b>16.110.000</b>	<b>2.417.032.568</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>168.455.441</b>	<b>259.378.034</b>	<b>1.973.089.093</b>	<b>16.110.000</b>	<b>2.417.032.568</b>

31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	34.485.207	401.890.367	2.965.031.440	16.683.000	3.418.090.014
Barmittel und Barmitteläquivalente	102.927.978	–	–	–	102.927.978
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>137.413.185</b>	<b>401.890.367</b>	<b>2.965.031.440</b>	<b>16.683.000</b>	<b>3.521.017.992</b>
Kontenüberziehung	32.786	–	–	–	32.786
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>32.786</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>32.786</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>137.380.399</b>	<b>401.890.367</b>	<b>2.965.031.440</b>	<b>16.683.000</b>	<b>3.520.985.206</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Local Currency

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	68.217.227	437.615.624	815.481.065	15.136.550	1.336.450.466
Barmittel und Barmitteläquivalente	12.401.585	–	–	–	12.401.585
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>80.618.812</b>	<b>437.615.624</b>	<b>815.481.065</b>	<b>15.136.550</b>	<b>1.348.852.051</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>80.618.812</b>	<b>437.615.624</b>	<b>815.481.065</b>	<b>15.136.550</b>	<b>1.348.852.051</b>

31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	111.679.622	710.789.213	1.094.038.024	16.157.350	1.932.664.209
Barmittel und Barmitteläquivalente	125.681.417	–	–	–	125.681.417
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>237.361.039</b>	<b>710.789.213</b>	<b>1.094.038.024</b>	<b>16.157.350</b>	<b>2.058.345.626</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>237.361.039</b>	<b>710.789.213</b>	<b>1.094.038.024</b>	<b>16.157.350</b>	<b>2.058.345.626</b>

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	9.270.322	121.904.154	306.840.370	13.380.558	451.395.404
Barmittel und Barmitteläquivalente	4.035.002	–	–	–	4.035.002
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>13.305.324</b>	<b>121.904.154</b>	<b>306.840.370</b>	<b>13.380.558</b>	<b>455.430.406</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>13.305.324</b>	<b>121.904.154</b>	<b>306.840.370</b>	<b>13.380.558</b>	<b>455.430.406</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	21.491.484	264.533.606	583.346.278	16.177.245	885.548.613
Barmittel und Barmitteläquivalente	42.675.944	–	–	–	42.675.944
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>64.167.428</b>	<b>264.533.606</b>	<b>583.346.278</b>	<b>16.177.245</b>	<b>928.224.557</b>
Kontenüberziehung	1.259	–	–	–	1.259
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>1.259</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.259</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>64.168.687</b>	<b>264.533.606</b>	<b>583.346.278</b>	<b>16.177.245</b>	<b>928.225.816</b>

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	517.189	8.561.955	40.718.771	–	49.797.915
Barmittel und Barmitteläquivalente	3.413.071	–	–	–	3.413.071
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>3.930.260</b>	<b>8.561.955</b>	<b>40.718.771</b>	<b>–</b>	<b>53.210.986</b>
Kontenüberziehung	12	–	–	–	12
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>12</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>12</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>3.930.248</b>	<b>8.561.955</b>	<b>40.718.771</b>	<b>–</b>	<b>53.210.974</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.765.743	6.686.708	34.899.083	–	43.351.534
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.840.473	–	–	–	2.840.473
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>4.606.216</b>	<b>6.686.708</b>	<b>34.899.083</b>	<b>–</b>	<b>46.192.007</b>
Kontenüberziehung	128	–	–	–	128
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>128</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>128</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>4.606.088</b>	<b>6.686.708</b>	<b>34.899.083</b>	<b>–</b>	<b>46.191.879</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	3.933.441	11.682.263	30.292.316	–	45.908.020
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.710.742	–	–	–	1.710.742
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	5.644.183	11.682.263	30.292.316	–	47.618.762
Kontenüberziehung	388	–	–	–	388
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	388	–	–	–	388
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	5.643.795	11.682.263	30.292.316	–	47.618.374

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	3.466.053	11.662.078	33.522.967	–	48.651.098
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.388.212	–	–	–	2.388.212
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	5.854.265	11.662.078	33.522.967	–	51.039.310
Kontenüberziehung	1.916	–	–	–	1.916
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	1.916	–	–	–	1.916
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	5.852.349	11.662.078	33.522.967	–	51.037.394

Euro Opportunistic Bond

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	65.594	2.688.537	5.792.884	–	8.547.015
Barmittel und Barmitteläquivalente	473.148	–	–	–	473.148
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	538.742	2.688.537	5.792.884	–	9.020.163
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	538.7423	2.688.537	5.792.884	–	9.020.163

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Euro Opportunistic Bond (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	2.869.980	7.574.629	–	10.444.609
Barmittel und Barmitteläquivalente	520.124	–	–	–	520.124
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	520.124	2.869.980	7.574.629	–	10.964.733
Kontenüberziehung	261	–	–	–	261
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	261	–	–	–	261
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	519.863	2.869.980	7.574.629	–	10.964.472

## European High Yield Bond

## 31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	380.405	17.612.967	14.489.268	–	32.482.640
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.372.196	–	–	–	1.372.196
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	1.752.601	17.612.967	14.489.268	–	33.854.836
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	1.752.601	17.612.967	14.489.268	–	33.854.836

## 31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	18.936.402	18.057.201	–	36.993.603
Barmittel und Barmitteläquivalente	950.762	–	–	–	950.762
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	950.762	18.936.402	18.057.201	–	37.944.365
Kontenüberziehung	451	–	–	–	451
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	451	–	–	–	451
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	950.311	18.936.402	18.057.201	–	37.943.914

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Event Driven<sup>1</sup>

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	33.823.354	–	–	–	33.823.354
Barmittel und Barmitteläquivalente	6.873.963	–	–	–	6.873.963
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>40.697.317</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>40.697.317</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>40.697.317</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>40.697.317</b>

Global Bond

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.208.864	44.832.896	83.833.941	–	130.875.701
Barmittel und Barmitteläquivalente	4.700.090	–	–	–	4.700.090
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>6.908.954</b>	<b>44.832.896</b>	<b>83.833.941</b>	<b>–</b>	<b>135.575.791</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>6.908.954</b>	<b>44.832.896</b>	<b>83.833.941</b>	<b>–</b>	<b>135.575.791</b>

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	8.490.240	40.797.187	124.104.528	–	173.391.955
Barmittel und Barmitteläquivalente	10.799.983	–	–	–	10.799.983
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>19.290.223</b>	<b>40.797.187</b>	<b>124.104.528</b>	<b>–</b>	<b>184.191.938</b>
Kontenüberziehung	1.872	–	–	–	1.872
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>1.872</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.872</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>19.288.351</b>	<b>40.797.187</b>	<b>124.104.528</b>	<b>–</b>	<b>184.190.066</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Global Diversified Income FMP – 2024

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	23.835.209	128.689.334	1.743.330	–	154.267.873
Barmittel und Barmitteläquivalente	50.248.991	–	–	–	50.248.991
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>74.084.200</b>	<b>128.689.334</b>	<b>1.743.330</b>	<b>–</b>	<b>204.516.864</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>74.084.200</b>	<b>128.689.334</b>	<b>1.743.330</b>	<b>–</b>	<b>204.516.864</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	915.935	215.187.845	1.829.721	–	217.933.501
Barmittel und Barmitteläquivalente	13.562.145	–	–	–	13.562.145
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>14.478.080</b>	<b>215.187.845</b>	<b>1.829.721</b>	<b>–</b>	<b>231.495.646</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>14.478.080</b>	<b>215.187.845</b>	<b>1.829.721</b>	<b>–</b>	<b>231.495.646</b>

## Global Flexible Credit Income

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.261.296	83.431.268	265.368.388	5.585.898	355.646.850
Barmittel und Barmitteläquivalente	10.118.861	–	–	–	10.118.861
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>11.380.157</b>	<b>83.431.268</b>	<b>265.368.388</b>	<b>5.585.898</b>	<b>365.765.711</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>11.380.157</b>	<b>83.431.268</b>	<b>265.368.388</b>	<b>5.585.898</b>	<b>365.765.711</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.414.213	103.469.367	506.949.775	474.751	612.308.106
Barmittel und Barmitteläquivalente	80.947.344	–	–	–	80.947.344
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>82.361.557</b>	<b>103.469.367</b>	<b>506.949.775</b>	<b>474.751</b>	<b>693.255.450</b>
Kontenüberziehung	4.458	–	–	–	4.458
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>4.458</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.458</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>82.357.099</b>	<b>103.469.367</b>	<b>506.949.775</b>	<b>474.751</b>	<b>693.250.992</b>

Global High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	3.726.199	127.664.393	142.628.218	–	274.018.810
Barmittel und Barmitteläquivalente	5.259.514	–	–	–	5.259.514
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>8.985.713</b>	<b>127.664.393</b>	<b>142.628.218</b>	<b>–</b>	<b>279.278.324</b>
Kontenüberziehung	15	–	–	–	15
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>15</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>15</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>8.985.698</b>	<b>127.664.393</b>	<b>142.628.218</b>	<b>–</b>	<b>279.278.309</b>

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	12.518.903	26.315.490	–	38.834.393
Barmittel und Barmitteläquivalente	640.813	–	–	–	640.813
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>640.813</b>	<b>12.518.903</b>	<b>26.315.490</b>	<b>–</b>	<b>39.475.206</b>
Kontenüberziehung	79	–	–	–	79
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>79</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>79</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>640.734</b>	<b>12.518.903</b>	<b>26.315.490</b>	<b>–</b>	<b>39.475.127</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Global High Yield Sustainable Action

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	106.321	7.096.577	7.336.654	–	14.539.552
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.033.221	–	–	–	1.033.221
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.139.542</b>	<b>7.096.577</b>	<b>7.336.654</b>	<b>–</b>	<b>15.572.773</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>1.139.542</b>	<b>7.096.577</b>	<b>7.336.654</b>	<b>–</b>	<b>15.572.773</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	3.798.659	13.025.036	–	16.823.695
Barmittel und Barmitteläquivalente	660.970	–	–	–	660.970
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>660.970</b>	<b>3.798.659</b>	<b>13.025.036</b>	<b>–</b>	<b>17.484.665</b>
Kontenüberziehung	92	–	–	–	92
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>92</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>92</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>660.878</b>	<b>3.798.659</b>	<b>13.025.036</b>	<b>–</b>	<b>17.484.573</b>

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	993.712	27.655.463	54.876.198	–	83.525.373
Barmittel und Barmitteläquivalente	3.565.231	–	–	–	3.565.231
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>4.558.943</b>	<b>27.655.463</b>	<b>54.876.198</b>	<b>–</b>	<b>87.090.604</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>4.558.943</b>	<b>27.655.463</b>	<b>54.876.198</b>	<b>–</b>	<b>87.090.604</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup> (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.022.591	31.399.264	64.022.591	–	96.444.446
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.208.142	–	–	–	1.208.142
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>2.230.733</b>	<b>31.399.264</b>	<b>64.022.591</b>	<b>–</b>	<b>97.652.588</b>
Kontenüberziehung	84	–	–	–	84
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>84</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>84</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>2.230.649</b>	<b>31.399.264</b>	<b>64.022.591</b>	<b>–</b>	<b>97.652.504</b>

Global Opportunistic Bond

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.329.048	20.667.995	52.201.854	1.801.216	77.000.113
Barmittel und Barmitteläquivalente	5.863.263	–	–	–	5.863.263
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>8.192.311</b>	<b>20.667.995</b>	<b>52.201.854</b>	<b>1.801.216</b>	<b>82.863.376</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>8.192.311</b>	<b>20.667.995</b>	<b>52.201.854</b>	<b>1.801.216</b>	<b>82.863.376</b>

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	3.417.208	21.021.500	65.114.042	5.754.344	95.307.094
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.383.723	–	–	–	1.383.723
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>4.800.931</b>	<b>21.021.500</b>	<b>65.114.042</b>	<b>5.754.344</b>	<b>96.690.817</b>
Kontenüberziehung	637	–	–	–	637
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>637</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>637</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>4.800.294</b>	<b>21.021.500</b>	<b>65.114.042</b>	<b>5.754.344</b>	<b>96.690.180</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## High Yield Bond

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	772.189.089	1.323.830.144	18.294.706	2.114.313.939
Barmittel und Barmitteläquivalente	134.476.435	–	–	–	134.476.435
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>134.476.435</b>	<b>772.189.089</b>	<b>1.323.830.144</b>	<b>18.294.706</b>	<b>2.248.790.374</b>
Kontenüberziehung	149	–	–	–	149
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>149</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>149</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>134.476.286</b>	<b>772.189.089</b>	<b>1.323.830.144</b>	<b>18.294.706</b>	<b>2.248.790.225</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	561.705.195	2.440.908.540	35.876.632	3.038.490.367
Barmittel und Barmitteläquivalente	172.469.054	–	–	–	172.469.054
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>172.469.054</b>	<b>561.705.195</b>	<b>2.440.908.540</b>	<b>35.876.632</b>	<b>3.210.959.421</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>172.469.054</b>	<b>561.705.195</b>	<b>2.440.908.540</b>	<b>35.876.632</b>	<b>3.210.959.421</b>

## Macro Opportunities FX

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	32.136.143	–	–	–	32.136.143
Barmittel und Barmitteläquivalente	131.107	–	–	–	131.107
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>32.267.250</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>32.267.250</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>32.267.250</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>32.267.250</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	45.239.269	–	–	–	45.239.269
Barmittel und Barmitteläquivalente	204.588	–	–	–	204.588
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>45.443.857</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>45.443.857</b>
Kontenüberziehung	234	–	–	–	234
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>234</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>234</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>45.443.623</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>45.443.623</b>

Multi-Asset Income

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	944.744	4.255.409	3.815.441	9.015.594
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.795.321	–	–	–	1.795.321
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.795.321</b>	<b>944.744</b>	<b>4.255.409</b>	<b>3.815.441</b>	<b>10.810.915</b>
Kontenüberziehung	3.963	–	–	–	3.963
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>3.963</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.963</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>1.791.358</b>	<b>944.744</b>	<b>4.255.409</b>	<b>3.815.441</b>	<b>10.806.952</b>

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	2.466.145	7.625.111	9.188.710	19.279.966
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.651.672	–	–	–	2.651.672
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>2.651.672</b>	<b>2.466.145</b>	<b>7.625.111</b>	<b>9.188.710</b>	<b>21.931.638</b>
Kontenüberziehung	86	–	–	–	86
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>86</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>86</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>2.651.586</b>	<b>2.466.145</b>	<b>7.625.111</b>	<b>9.188.710</b>	<b>21.931.552</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Short Duration Emerging Market Debt

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	650.064.015	3.596.608.250	537.916.711	70.347.000	4.854.935.976
Barmittel und Barmitteläquivalente	196.555.616	–	–	–	196.555.616
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>846.619.631</b>	<b>3.596.608.250</b>	<b>537.916.711</b>	<b>70.347.000</b>	<b>5.051.491.592</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>846.619.631</b>	<b>3.596.608.250</b>	<b>537.916.711</b>	<b>70.347.000</b>	<b>5.051.491.592</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	847.514.676	4.731.757.845	980.325.745	72.849.100	6.632.447.366
Barmittel und Barmitteläquivalente	219.363.403	–	–	–	219.363.403
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.066.878.079</b>	<b>4.731.757.845</b>	<b>980.325.745</b>	<b>72.849.100</b>	<b>6.851.810.769</b>
Kontenüberziehung	23.698	–	–	–	23.698
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>23.698</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>23.698</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>1.066.854.381</b>	<b>4.731.757.845</b>	<b>980.325.745</b>	<b>72.849.100</b>	<b>6.851.787.071</b>

## Short Duration High Yield SDG Engagement

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	23.828.866	460.111.988	28.086.847	1.221.039	513.248.740
Barmittel und Barmitteläquivalente	27.853.758	–	–	–	27.853.758
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>51.682.624</b>	<b>460.111.988</b>	<b>28.086.847</b>	<b>1.221.039</b>	<b>541.102.498</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>51.682.624</b>	<b>460.111.988</b>	<b>28.086.847</b>	<b>1.221.039</b>	<b>541.102.498</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	8.832.845	478.218.687	120.841.386	2.288.465	610.181.383
Barmittel und Barmitteläquivalente	31.228.925	–	–	–	31.228.925
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	40.061.770	478.218.687	120.841.386	2.288.465	641.410.308
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	40.061.770	478.218.687	120.841.386	2.288.465	641.410.308

Strategic Income

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	114.007.287	233.727.570	1.015.663.596	58.225.837	1.421.624.290
Barmittel und Barmitteläquivalente	104.978.500	–	–	–	104.978.500
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	218.985.787	233.727.570	1.015.663.596	58.225.837	1.526.602.790
Kontenüberziehung	155	–	–	–	155
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	155	–	–	–	155
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	218.985.632	233.727.570	1.015.663.596	58.225.837	1.526.602.635

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	220.611.370	264.470.285	1.015.655.814	65.268.964	1.566.006.433
Barmittel und Barmitteläquivalente	149.491.358	–	–	–	149.491.358
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	370.102.728	264.470.285	1.015.655.814	65.268.964	1.715.497.791
Kontenüberziehung	130	–	–	–	130
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	130	–	–	–	130
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	370.102.598	264.470.285	1.015.655.814	65.268.964	1.715.497.661

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	256.500	14.322.223	13.754.217	–	28.332.940
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.770.190	–	–	–	2.770.190
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>3.026.690</b>	<b>14.322.223</b>	<b>13.754.217</b>	<b>–</b>	<b>31.103.130</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>3.026.690</b>	<b>14.322.223</b>	<b>13.754.217</b>	<b>–</b>	<b>31.103.130</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	13.298.664	8.915.320	–	22.213.984
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.325.513	–	–	–	2.325.513
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>2.325.513</b>	<b>13.298.664</b>	<b>8.915.320</b>	<b>–</b>	<b>24.539.497</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>2.325.513</b>	<b>13.298.664</b>	<b>8.915.320</b>	<b>–</b>	<b>24.539.497</b>

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	979.077	32.045.482	58.359.521	–	91.384.080
Barmittel und Barmitteläquivalente	6.953.109	–	–	–	6.953.109
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>7.932.186</b>	<b>32.045.482</b>	<b>58.359.521</b>	<b>–</b>	<b>98.337.189</b>
Kontenüberziehung	1.508.656	–	–	–	1.508.656
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>1.508.656</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.508.656</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>6.423.530</b>	<b>32.045.482</b>	<b>58.359.521</b>	<b>–</b>	<b>96.828.533</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	47.447.934	93.393.586	–	140.841.520
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.061.738	–	–	–	1.061.738
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	1.061.738	47.447.934	93.393.586	–	141.903.258
Kontenüberziehung	381	–	–	–	381
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	381	–	–	–	381
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	1.061.357	47.447.934	93.393.586	–	141.902.877

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency<sup>1</sup>

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	13.872.499	129.941.857	–	143.814.356
Barmittel und Barmitteläquivalente	8.625.196	–	–	–	8.625.196
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	8.625.196	13.872.499	129.941.857	–	152.439.552
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	8.625.196	13.872.499	129.941.857	–	152.439.552

Ultra Short Term Euro Bond

31. Dezember 2022

	Bis zu 1 Jahr	1 - 5 Jahre	Über 5 Jahre	Unverzinslich	Insgesamt
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Umlaufvermögen</b>					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	47.528.662	511.849.443	239.919.963	–	799.298.068
Barmittel und Barmitteläquivalente	10.039.473	–	–	–	10.039.473
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	57.568.135	511.849.443	239.919.963	–	809.337.541
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	–	–	–	–	–
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	57.568.135	511.849.443	239.919.963	–	809.337.541

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	51.570.723	711.635.733	274.170.065	–	1.037.376.521
Barmittel und Barmitteläquivalente	109.410.277	–	–	–	109.410.277
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>160.981.000</b>	<b>711.635.733</b>	<b>274.170.065</b>	<b>–</b>	<b>1.146.786.798</b>
Kontenüberziehung	48.643	–	–	–	48.643
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>48.643</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>48.643</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>160.932.357</b>	<b>711.635.733</b>	<b>274.170.065</b>	<b>–</b>	<b>1.146.738.155</b>

## Uncorrelated Strategies

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.594.362.150	122.919.502	31.139.060	140.344.310	1.888.765.022
Barmittel und Barmitteläquivalente	301.147.318	–	–	–	301.147.318
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.895.509.468</b>	<b>122.919.502</b>	<b>31.139.060</b>	<b>140.344.310</b>	<b>2.189.912.340</b>
Kontenüberziehung	22.735	–	–	–	22.735
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>22.735</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>22.735</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>1.895.486.733</b>	<b>122.919.502</b>	<b>31.139.060</b>	<b>140.344.310</b>	<b>2.189.889.605</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	859.959.488	–	131.058.133	26.813.407	1.017.831.028
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.073.013.116	–	–	–	1.073.013.116
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.932.972.604</b>	<b>–</b>	<b>131.058.133</b>	<b>26.813.407</b>	<b>2.090.844.144</b>
Kontenüberziehung	6.141	–	–	–	6.141
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>6.141</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.141</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>1.932.966.463</b>	<b>–</b>	<b>131.058.133</b>	<b>26.813.407</b>	<b>2.090.838.003</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

XXXXXXXXXXXXX<sup>2</sup>

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	449.200.010	1.270.800	11.950.635	20.035.760	482.457.205
Barmittel und Barmitteläquivalente	66.208.500	–	–	–	66.208.500
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>515.408.510</b>	<b>1.270.800</b>	<b>11.950.635</b>	<b>20.035.760</b>	<b>548.665.705</b>
Kontenüberziehung	27.694	–	–	–	27.694
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>27.694</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>27.694</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>515.380.816</b>	<b>1.270.800</b>	<b>11.950.635</b>	<b>20.035.760</b>	<b>548.638.011</b>

US Equity Index PutWrite

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	300.435.106	331.828.970	–	–	632.264.076
Barmittel und Barmitteläquivalente	44.491.927	–	–	–	44.491.927
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>344.927.033</b>	<b>331.828.970</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>676.756.003</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>344.927.033</b>	<b>331.828.970</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>676.756.003</b>

31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	183.052.480	209.036.594	–	–	392.089.074
Barmittel und Barmitteläquivalente	82.924.686	–	–	–	82.924.686
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>265.977.166</b>	<b>209.036.594</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>475.013.760</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>265.977.166</b>	<b>209.036.594</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>475.013.760</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## US Long Short Equity

## 31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	2.652.603	5.751.595	159.755.260	168.159.458
Barmittel und Barmitteläquivalente	34.444.171	–	–	–	34.444.171
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>34.444.171</b>	<b>2.652.603</b>	<b>5.751.595</b>	<b>159.755.260</b>	<b>202.603.629</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>34.444.171</b>	<b>2.652.603</b>	<b>5.751.595</b>	<b>159.755.260</b>	<b>202.603.629</b>

## 31. Dezember 2021

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US\$	1 - 5 Jahre US\$	Über 5 Jahre US\$	Unverzinslich US\$	Insgesamt US\$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	5.017.926	913.786	411.311.087	417.242.799
Barmittel und Barmitteläquivalente	46.501.757	–	–	–	46.501.757
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>46.501.757</b>	<b>5.017.926</b>	<b>913.786</b>	<b>411.311.087</b>	<b>463.744.556</b>
<b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b>	<b>46.501.757</b>	<b>5.017.926</b>	<b>913.786</b>	<b>411.311.087</b>	<b>463.744.556</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko

Das Kreditrisiko (oder Ausfallrisiko) ist das Risiko, dass ein Emittent oder eine Gegenpartei einer gegenüber dem Fonds eingegangenen Verbindlichkeit nicht nachkommen kann. Der Fonds hat zum Grundsatz, Finanzinstrumente mit unterschiedlichen, bonitätsmäßig einwandfreien Gegenparteien einzugehen. Deshalb erwartet der Fonds keine wesentlichen Kreditverluste aus seinen Finanzinstrumenten. Der Manager bewertet die Kreditqualität der Gegenparteien, die von dem Fonds genutzt werden. Diese Bewertung beinhaltet mindestens eine anfängliche und eine jährliche Kreditbewertung auf Grundlage der Finanzdaten und/oder Ratings Dritter. Gegenparteien, die für Devisenterminkontrakte und andere außerbörsliche Derivategeschäfte (OTC-Derivate) genutzt werden, unterliegen einer strengeren Überwachung, zu der auch detaillierte Kreditprüfungen mit Ratings Dritter und/oder Faktoren wie Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Qualität der Verwaltung, Gewinne und Liquidität gehören. Der Manager verfolgt zudem die Nachrichten aus dem Finanzsektor, um einen Überblick über Trends in Sektoren und Ereignisse zu bekommen, die einen direkten Einfluss auf spezielle Gegenparteien haben können.

Das maximale Kreditrisiko der Gesellschaft (wobei der Wert von gehaltenen Sicherheiten oder anderen Wertpapieren unberücksichtigt bleibt) in dem Fall, dass Gegenparteien ihren Verpflichtungen zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 in Bezug auf jede Klasse erfasster finanzieller Vermögenswerte, mit Ausnahme von Derivaten, nicht nachkommen, ist der Buchwert dieser Vermögenswerte gemäß Angabe in der Bilanz.

Transaktionen im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten werden in der Regel mit Gegenparteien getätigt, mit denen das Portfolio Master Netting Agreements unterzeichnet hat. Master Netting Agreements sehen die Nettoabwicklung von Kontrakten mit derselben Gegenpartei bei einem Ausfall vor. Das mit derivativen finanziellen Vermögenswerten, die einer Master-Netting-Vereinbarung unterliegen, verbundene Kreditrisiko wird nur insoweit eliminiert, als dass gegenüber derselben Gegenpartei fällige finanzielle Verbindlichkeiten abgerechnet werden, nachdem die Vermögenswerte veräußert wurden. Das Risiko wird auch durch Sicherheiten gesteuert, auf die der Fonds bei einem Zahlungsausfall einer Gegenpartei ohne Rückgriff auf diese Gegenpartei sofortigen Zugriff hat.

An Wertpapierleihverträgen beteiligte Portfolios sind ebenfalls einem Gegenparteirisiko ausgesetzt. Um dieses Risiko zu minimieren, werden Sicherheiten in Form von Barwerten und/oder hoch bewerteten Staatsanleihen gehalten, die mindestens 102 % des Wertes der verliehenen Wertpapiere entsprechen. In Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften müssen die für Wertpapierleihgeschäfte akzeptierten Sicherheiten an die Verwahrstelle des Fonds übertragen werden und den Portfolios bei einem Zahlungsausfall der Gegenpartei ohne Rückgriff auf diese Gegenpartei sofort zur Verfügung stehen. Zwar ist es beabsichtigt, dass der Wert der erhaltenen Sicherheiten jederzeit dem Wert der verliehenen Wertpapiere entspricht oder ihn übersteigt, doch besteht im Falle einer plötzlichen Aufwärtsbewegung am Markt das Risiko, dass der Wert der Sicherheiten unter den Wert der übertragenen Wertpapiere fällt. Eine detaillierte Liste der Gegenparteien bei Wertpapierleihgeschäften zum 31. Dezember 2022 finden Sie unter Konzentrierte Daten in Anhang IV.

Kassenbestände, die über in den Büchern von Brown Brothers Harriman & Co. („BBH“) geführte Konten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten von BBH, während Kassenbestände, die über direkt in den Büchern einer Drittbank als Korrespondenzbank für Kassenbestände, einer Unterdepotbank oder eines Maklers geführte Konten gehalten werden (zusammen die „Vertreterkonten“), Verbindlichkeiten des Vertreters sind. Kassenbestände, die über Vertreterkonten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten des Vertreters und begründen ein direktes Schuldner/Gläubiger-Verhältnis zwischen dem Vertreter und dem Fonds. Dementsprechend ist BBH dafür verantwortlich, bei der Verwaltung dieser Vertreterkonten, wenn sie den Vertreter ernannt hat (d. h. im Falle von Korrespondenzbanken für Kassenbestände und Unterdepotbanken), angemessene Sorgfalt walten zu lassen, haftet jedoch nicht für die Rückzahlung, wenn der Vertreter aufgrund eines Konkurses, einer Insolvenz oder aus anderen Gründen die Rückzahlung nicht leistet. Zum 31. Dezember 2022 lagen sämtliche als Tagesgelder gehaltenen Barmittel und Bankguthaben wie in Anmerkung 3 angegeben bei Drittinstituten. Barmittel und Barmitteläquivalente mit einem langfristigen Kreditrating von Investment Grade gemäß Standard & Poor's (31. Dezember 2021: gleich). BBH hat ein langfristiges Kreditrating von A+ (31. Dezember 2021: A+) gemäß Fitch-Rating.

Die Verwahrstelle muss sicherstellen, dass die gesetzliche Trennung der von ihr verwahrten unbaren Vermögenswerte eingehalten wird, dass diese Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis gehalten werden und dass geeignete interne Kontrollsysteme vorhanden sind, so dass in den Aufzeichnungen klar die Art und Höhe aller verwahrten Vermögenswerte identifiziert werden. Als Verwahrstelle muss Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited („BBHTS“) das Eigentum jedes Vermögenswertes und den Aufbewahrungsort der Eigentumstitel für jeden Vermögenswert sicherstellen.

Das zentrale Risiko für den Fonds bleibt das Kreditrisiko, d. h. dass der Manager einen Schuldtitel oder eine Anleihe eines bestimmten Emittenten erwirbt und sie sich nicht erwartungsgemäß entwickelt und entweder Zahlungen ausfallen oder ein erheblicher Rückgang des Sekundärmarktswerts eintritt.

Um dieses Risiko zu mindern, führt der Manager eine unabhängige Due-Diligence-Prüfung jedes Kreditnehmers durch und fokussiert sich auf stabile, leistungsfähige Anleihen mit soliden Erfolgsbilanzen über vorausgegangenen Konjunkturzyklen. Außerdem wird auch die Größe eines Emittenten berücksichtigt. Der Manager favorisiert weiterhin die größeren Emittenten auf dem Markt, die sich über ein Emissionsvolumen von mehr als 500 Mio. US\$ definieren. Hinter diesen Emittenten stehen breitere Konsortien, was die Liquidität auf dem Sekundärmarkt steigern kann. Der Manager filtert nicht nur kleinere Emittenten heraus, sondern schließt auch stark zyklische Branchen und Unternehmen mit begrenzter Ertragstransparenz aus seinem Anlageverfahren aus.

Wurde eine bestimmte Anlage getätigt, wird sie vom Manager überwacht. Es wird für jede Anlage fortlaufend ein Spektrum einschlägiger Daten überprüft, insbesondere maßgebliche Finanztreiber, Rohstoffpreise, Aktienkurse, aufsichtsrechtliche Entwicklungen, Finanzergebnisse, Pressemeldungen und Kommentare des Managements, um Hinweise auf eine Verschlechterung der Bonität zu erkennen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Um dieses Risiko zusätzlich zu steuern, stellen die Direktoren sicher, dass der Manager die von den Direktoren festgelegten Richtlinien zu Anlagelimits und -einschränkungen einhält. Die Direktoren überwachen mit dem Manager auf jeder ihrer Sitzungen die Umsetzung und die Ergebnisse des Anlageverfahrens und sie überwachen ferner die Risikofaktoren für jedes Portfolio.

Bei den Wertpapieren, die BBH in Verwahrung hat, handelt es sich um Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Participatory Notes, ABS-Anleihen und REITs. Alle von BBH (als globale Unterdepotbank für und im Namen von BBHTS und zu Gunsten von deren jeweiligen Kunden) verwahrten Wertpapiere werden von den eigenen Vermögenswerten der BBH getrennt, ungeachtet dessen, ob sie im Tresor von BBH, auf separaten Konten in den Büchern ihrer Unterdepotbanken oder auf einem bei einer Wertpapiersammelbank (Central Securities Depository) geführten Konto gehalten werden. BBH führt für jeden Kunden in ihren Büchern sowie in den Büchern der Unterdepotbank auf dem lokalen Markt, wenn dies möglich ist, separate Konten. Als Verwahrstelle muss BBHTS auch sicherstellen, dass unbare Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis über das Netzwerk globaler Unterdepotbanken der BBH gehalten werden.

Die Unterdepotbanken von BBH sind durch Verträge mit BBH und allgemein gemäß dem Gesetz verpflichtet, die Wertpapiere von Depotkunden getrennt vom allgemeinen Bankvermögen der Unterdepotbank zu verwahren.

BBH führt über ihre Network Management Group zu Beginn und danach auf laufender Basis Due-Diligence-Prüfungen bei den Unterdepotbanken in ihrem globalen Verwahrstellennetz durch. Diese Prüfungen beinhalten eine Beurteilung der Service-Standards, des Sachverstandes des Managements, der Marktinformationen, des Verwahrstellenbetriebs, der Berichts- und technologischen Kapazitäten der Unterdepotbank sowie Prüfungen in Bezug auf ihre Reputation und Bonität am Markt und ihr dauerhaftes Engagement im Bereich der Verwahrstellendienstleistungen.

Mit jeder Unterdepotbank werden ein Service Level Agreement sowie die üblichen vertraglichen Vereinbarungen getroffen und diese regelmäßig im Rahmen von Service Review Meetings, einschließlich Due-Diligence-Meetings vor Ort, überprüft.

Die Risk and Credit Group von BBH führt regelmäßig Finanzanalysen bei allen Unterdepotbanken durch und konzentriert sich dabei unter anderem auf die Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Gewinne, Liquidität und Kredit-Ratings als wesentliche Kennzahlen. Diese Überprüfungen sind Bestandteil der Routineprüfungen, die BBH im Hinblick auf die finanzielle Stärke und Bonität einer Unterdepotbank vornimmt.

Die Manager überwacht das Risiko für die Gesellschaft gemäß den Richtlinien für OGAW-Fonds und berichtet den Direktoren auf regelmäßiger Basis.

Der Fonds investiert in Schuldtitel, die ein Bonitätsrating einer renommierten Ratingagentur erhalten können. Die Bonitätsratings in den nachstehenden Tabellen werden als Prozentsatz der festverzinslichen Wertpapiere berechnet, wenn ein wesentlicher Anteil des betreffenden Portfolios als festverzinsliche Wertpapiere gehalten wird. Ein Schuldtitel wird als Investment-Grade-Titel betrachtet, wenn er ein Bonitätsrating von BBB- oder höher von Standard & Poor's und von Baa3 oder höher von Moody's hat. Per 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 stellten sich die Engagements nach Bonitätsratings wie folgt dar:

## Asian Debt - Hard Currency

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	18.090.069	12.557.968
Staatsanleihen	2.090.986	1.499.303
<b>Derivate</b>	(6.712)	(1.208)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	1.180.261	151.741
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	55.253	104.923

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	70,75	64,60
Ohne Investment Grade	21,22	25,29
Ohne Rating	8,03	10,11
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

China Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 CNY	31. Dezember 2021 CNY
Einlagenzertifikate	92.924.345	38.863.400
Unternehmensanleihen	272.165.839	385.785.879
Staatsanleihen	60.073.670	119.228.610
<b>Derivate</b>	1.181.877	(1.029.880)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	22.788.957	29.971.297
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	839.388	1.045.401

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	19,36	3,01
Ohne Investment Grade	3,71	5,55
Ohne Rating	76,93	91,44
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

CLO Income

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	112.870.953	133.274.949
<b>Derivate</b>	1.943.252	(545.159)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	20.349.795	24.669.895
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(945)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	320.000	–

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	2,44	–
Ohne Investment Grade	97,56	71,52
Ohne Rating	–	28,48
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Commodities

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$
Agency Bonds	10.530.836
Unternehmensanleihen	26.223.262
Schatzwechsel	39.453.874
<b>Derivate</b>	1.186.450
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	8.094.998
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	(5.450.000)

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %
Investment Grade	100,00
<b>Insgesamt</b>	100,00

## Corporate Hybrid Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 EUR	31. Dezember 2021 EUR
Unternehmensanleihen	1.638.001.345	2.250.494.338
<b>Derivate</b>	(21.157.336)	(1.985.960)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	124.965.163	171.915.142
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(81.862)

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	58,88	56,36
Ohne Investment Grade	43,54	43,64
Ohne Rating	(2,42)	–
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	784.977.470	1.162.113.940
Staatsanleihen	1.508.020.941	2.239.293.074
<b>Derivate</b>	25.569.299	24.196.787
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	107.924.157	102.927.978
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(32.786)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	3.276.177	2.618.513

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	36,49	37,48
Ohne Investment Grade	59,84	58,27
Ohne Rating	3,67	4,25
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

Emerging Market Debt - Local Currency

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Einlagenzertifikate	18.492.177	–
Unternehmensanleihen	22.468.723	33.373.484
Staatsanleihen	1.280.353.016	1.796.211.686
Schatzwechsel	–	86.921.689
<b>Derivate</b>	(33.615.251)	(31.153.552)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	12.401.585	125.681.417
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	54.984.796	53.928.225
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	(3.980.000)	(5.460.000)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	50,41	45,36
Ohne Investment Grade	16,94	11,37
Ohne Rating	32,65	43,27
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	149.902.253	299.501.688
Staatsanleihen	288.112.593	555.754.753
Schatzwechsel	–	14.114.927
<b>Derivate</b>	<b>(2.073.158)</b>	<b>(3.649.310)</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>4.035.002</b>	<b>42.675.944</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>–</b>	<b>(1.259)</b>
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	<b>9.999.389</b>	<b>12.466.134</b>
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	<b>(840.000)</b>	<b>(1.040.000)</b>

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	46,74	40,77
Ohne Investment Grade	36,08	35,92
Ohne Rating	17,18	23,31
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	7.512.041	9.721.900
Staatsanleihen	42.285.874	31.953.570
Schatzwechsel	–	1.676.064
<b>Derivate</b>	<b>557.983</b>	<b>614.939</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>3.413.071</b>	<b>2.840.473</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>(12)</b>	<b>(128)</b>
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	<b>424.677</b>	<b>270.656</b>

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	84,73	80,36
Ohne Investment Grade	0,61	0,81
Ohne Rating	14,66	18,83
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return

Anlagen:	31. Dezember 2022 EUR	31. Dezember 2021 EUR
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	2.319.216	2.053.891
Unternehmensanleihen	23.938.251	17.300.482
Staatsanleihen	19.650.553	29.296.725
<b>Derivate</b>	332.738	318.174
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	1.710.742	2.388.212
<b>Kontenüberziehung</b>	(388)	(1.916)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	252.313	1.030.197
<b>Kreditratings der Schuldtitel</b>		
<b>Portfolio nach Rating</b>	<b>31. Dezember 2022 %</b>	<b>31. Dezember 2021 %</b>
Investment Grade	66,92	64,80
Ohne Investment Grade	9,37	12,18
Ohne Rating	23,71	23,02
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Euro Opportunistic Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 EUR	31. Dezember 2021 EUR
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	462.816	298.264
Unternehmensanleihen	4.079.176	4.427.757
Staatsanleihen	4.005.023	5.718.588
<b>Derivate</b>	(69.064)	(58.347)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	473.148	520.124
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(261)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	258.450	252.711
<b>Kreditratings der Schuldtitel</b>		
<b>Portfolio nach Rating</b>	<b>31. Dezember 2022 %</b>	<b>31. Dezember 2021 %</b>
Investment Grade	68,11	70,32
Ohne Investment Grade	11,32	14,79
Ohne Rating	20,57	14,89
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## European High Yield Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 EUR	31. Dezember 2021 EUR
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	215.121	219.984
Unternehmensanleihen	32.065.000	36.562.368
Mittelfristige Schuldverschreibungen	202.519	211.251
<b>Derivate</b>	<b>(1.854.475)</b>	<b>456.520</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>1.372.196</b>	<b>950.762</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>–</b>	<b>(451)</b>

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	7,10	3,59
Ohne Investment Grade	92,05	96,41
Ohne Rating	0,85	–
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Event Driven<sup>1</sup>

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$
Schatzwechsel	33.823.354
<b>Derivate</b>	<b>917.817</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>6.873.963</b>

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %
Investment Grade	100,00
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Agency Bonds	2.423.190	2.795.723
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	8.861.707	15.793.186
Unternehmensanleihen	44.359.194	52.968.088
Staatsanleihen	53.670.009	82.196.271
Mortgage-Backed Securities	19.062.981	18.239.492
Kommunalanleihen	1.706.806	–
Schatzwechsel	791.814	1.399.195
<b>Derivate</b>	797.126	32.350
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	4.700.090	10.799.983
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(1.872)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	376.572	386.761

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	73,77	81,98
Ohne Investment Grade	–	0,13
Ohne Rating	26,23	17,89
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

Global Diversified Income FMP – 2024

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	150.336.737	206.932.749
Staatsanleihen	3.931.136	11.000.752
<b>Derivate</b>	523.570	(53.372)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	50.248.991	13.562.145

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	62,01	61,65
Ohne Investment Grade	36,23	38,35
Ohne Rating	1,76	–
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Global Flexible Credit Income

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	24.079.041	18.193.868
Unternehmensanleihen	316.164.124	580.860.589
Staatsanleihen	9.817.787	12.778.898
<b>Derivate</b>	17.497.471	(2.748.680)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	10.118.861	80.947.344
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(4.458)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	5.284.784	4.551.058
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	–	(250.000)

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	27,37	24,53
Ohne Investment Grade	71,41	73,97
Ohne Rating	1,22	1,50
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

## Global High Yield SDG Engagement

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	1.002.292
Unternehmensanleihen	273.005.334	37.832.101
Mittelfristige Schuldverschreibungen	1.013.476	–
<b>Derivate</b>	3.460.687	(334.087)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	5.259.514	640.813
<b>Kontenüberziehung</b>	(15)	(79)

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	1,24	3,62
Ohne Investment Grade	98,07	94,35
Ohne Rating	0,69	2,03
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global High Yield Sustainable Action

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	14.443.671	16.768.836
Mittelfristige Schuldverschreibungen	95.881	54.859
<b>Derivate</b>	<b>(350.409)</b>	<b>58.957</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>1.033.221</b>	<b>660.970</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>–</b>	<b>(92)</b>

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	2,45	0,93
Ohne Investment Grade	96,42	98,24
Ohne Rating	1,13	0,83
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	80.767.363	96.444.446
Staatsanleihen	2.758.010	–
<b>Derivate</b>	<b>(1.626.695)</b>	<b>455.185</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>3.565.231</b>	<b>1.208.142</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>–</b>	<b>(84)</b>

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	98,19	99,67
Ohne Investment Grade	1,36	–
Ohne Rating	0,45	0,33
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Global Opportunistic Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Agency Bonds	307.820	406.473
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	4.290.102	10.807.801
Unternehmensanleihen	35.431.699	43.655.885
Staatsanleihen	24.711.043	25.468.905
Mortgage-Backed Securities	10.458.233	6.090.483
Schatzwechsel	–	3.123.203
<b>Derivate</b>	<b>(2.418.728)</b>	<b>(1.310.440)</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>5.863.263</b>	<b>1.383.723</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>–</b>	<b>(637)</b>
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	<b>1.228.672</b>	<b>3.032.318</b>

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	44,28	42,16
Ohne Investment Grade	33,40	40,38
Ohne Rating	22,32	17,46
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## High Yield Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	21.830.306	43.351.226
Unternehmensanleihen	1.982.553.426	2.791.815.047
Mittelfristige Schuldverschreibungen	91.635.501	167.447.462
<b>Derivate</b>	<b>30.109.875</b>	<b>(18.947.974)</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>134.476.435</b>	<b>172.469.054</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>(149)</b>	<b>–</b>
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	<b>300.000</b>	<b>–</b>
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	<b>–</b>	<b>(430.000)</b>

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	3,93	0,31
Ohne Investment Grade	95,03	98,86
Ohne Rating	1,04	0,83
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Macro Opportunities FX

Anlagen:	31. Dezember 2022 EUR	31. Dezember 2021 EUR
Unternehmensanleihen	24.967.521	42.828.912
Staatsanleihen	2.778.639	200.575
Schatzwechsel	4.389.983	2.209.782
<b>Derivate</b>	<b>(811.369)</b>	<b>(792.577)</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>131.107</b>	<b>204.588</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>–</b>	<b>(234)</b>

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	96,29	95,12
Ohne Rating	3,71	4,88
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Multi-Asset Income

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Agency Bonds	7.644	–
Unternehmensanleihen	4.880.908	8.797.485
Staatsanleihen	311.601	1.293.771
<b>Derivate</b>	<b>(431.372)</b>	<b>50.542</b>
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	<b>1.795.321</b>	<b>2.651.672</b>
<b>Kontenüberziehung</b>	<b>(3.963)</b>	<b>(86)</b>
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	<b>628.167</b>	<b>497.475</b>

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	32,33	44,95
Ohne Investment Grade	67,52	55,05
Ohne Rating	0,15	–
<b>Insgesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Short Duration Emerging Market Debt

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	3.527.685.607	4.774.728.985
Staatsanleihen	1.205.827.702	1.784.869.281
Schatzwechsel	51.075.667	–
<b>Derivate</b>	20.870.051	3.691.873
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	196.555.616	219.363.403
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(23.698)

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	56,06	51,39
Ohne Investment Grade	40,46	44,40
Ohne Rating	3,48	4,21
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

## Short Duration High Yield SDG Engagement

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	477.638.711	561.613.956
Mittelfristige Schuldverschreibungen	23.578.927	46.278.962
Schatzwechsel	10.810.063	–
<b>Derivate</b>	17.725.693	(4.141.018)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	27.853.758	31.228.925

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	3,70	1,36
Ohne Investment Grade	96,15	98,64
Ohne Rating	0,15	–
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Strategic Income

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Agency Bonds	772.053	1.038.942
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	105.467.359	75.102.043
Unternehmensanleihen	637.567.177	573.071.433
Staatsanleihen	243.357.365	283.764.634
Mortgage-Backed Securities	346.893.475	261.330.721
Kommunalanleihen	20.744.098	17.076.840
Mittelfristige Schuldverschreibungen	579.804	99.300.565
Schatzwechsel	8.017.122	190.052.290
<b>Derivate</b>	19.437.605	(4.271.925)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	104.978.500	149.491.358
<b>Kontenüberziehung</b>	(155)	(130)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	3.722.665	4.768.320
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	(250.000)	(600.000)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	42,53	42,70
Ohne Investment Grade	29,92	38,01
Ohne Rating	27,55	19,29
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	27.495.016	20.977.042
Staatsanleihen	837.924	1.236.942
<b>Derivate</b>	266.230	2.187
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	2.770.190	2.325.513
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	58.035	25.422

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	9,14	16,94
Ohne Investment Grade	70,09	66,03
Ohne Rating	20,77	17,03
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	86.982.672	138.004.155
Staatsanleihen	4.401.408	2.837.365
<b>Derivate</b>	761.197	544.915
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	6.953.109	1.061.738
<b>Kontenüberziehung</b>	(1.508.656)	(381)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	166.695	188.296

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	48,27	45,28
Ohne Investment Grade	46,64	50,26
Ohne Rating	5,09	4,46
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency<sup>1</sup>

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$
Unternehmensanleihen	7.708.197
Staatsanleihen	136.106.159
<b>Derivate</b>	2.895.404
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	8.625.196
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	199.602

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %
Investment Grade	40,50
Ohne Investment Grade	59,31
Ohne Rating	0,19
<b>Insgesamt</b>	100,00

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond

Anlagen:	31. Dezember 2022 EUR	31. Dezember 2021 EUR
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	72.343.961	146.158.777
Unternehmensanleihen	670.503.994	828.802.596
Staatsanleihen	56.450.113	62.415.148
<b>Derivate</b>	(925.722)	1.155.799
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	10.039.473	109.410.277
<b>Kontenüberziehung</b>	–	(48.643)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	6.612.268	4.696.004

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	84,47	76,31
Ohne Investment Grade	12,72	8,43
Ohne Rating	2,81	15,26
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

Uncorrelated Strategies

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	161.387.060	119.867.609
Staatsanleihen	4.218.750	11.177.787
Schatzwechsel	1.582.793.462	859.959.488
<b>Derivate</b>	177.192.829	80.880.276
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	301.147.318	431.937.961
<b>Kontenüberziehung</b>	(22.735)	(2.559)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	737.006.142	287.815.875
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	(5.000)	(41.891.528)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	90,53	86,78
Ohne Investment Grade	2,21	0,66
Ohne Rating	7,26	12,56
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

XXXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$
Unternehmensanleihen	13.221.435
Schatzwechsel	449.200.010
<b>Derivate</b>	56.910.001
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	66.208.500
<b>Kontenüberziehung</b>	(27.694)
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	89.712.105
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>	(63.659)

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %
Investment Grade	97,14
Ohne Investment Grade	2,58
Ohne Rating	0,28
<b>Insgesamt</b>	100,00

## US Equity Index PutWrite

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Staatsanleihen	632.264.076	392.089.074
<b>Derivate</b>	2.309.131	(2.749.847)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	44.491.927	82.924.686

## Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	100,00	100,00
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

US Long Short Equity

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	8.400.448	5.922.382
<b>Derivate</b>	8.094.369	(18.190.468)
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	34.444.171	46.501.757
<b>Forderungen gegenüber Brokern</b>	11.644.215	25.837.918

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Investment Grade	59,83	4,59
Ohne Investment Grade	28,88	92,66
Ohne Rating	11,29	2,75
<b>Insgesamt</b>	100,00	100,00

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

US Small Cap Intrinsic Value

Anlagen:	31. Dezember 2022 US\$	31. Dezember 2021 US\$
Unternehmensanleihen	–	22.652
<b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>	8.840.096	10.093.059

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Ohne Investment Grade	–	100,00
<b>Insgesamt</b>	–	100,00

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****(e) Liquiditätsrisiko**

Die größten Liquiditätsrisiken des Fonds bestehen darin, die Aufträge von Anteilhabern zur Rücknahme zu erfüllen. Für den Fonds können täglich Barrücknahmen von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen anfallen. Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile sind auf Verlangen nach Wahl des Inhabers auf Basis des Nettoinventarwerts je Anteil des Portfolio zum Zeitpunkt der Rücknahme zurückzunehmen. Dieses Risiko wird vom Fonds gemildert, indem er vorwiegend in Wertpapiere investiert, die an den anerkannten Märkten in OECD-Mitgliedstaaten und anderen Ländern notiert sind oder gehandelt werden. Dadurch bestehen die Vermögenswerte aus realisierbaren Wertpapieren, die jederzeit verkauft werden können. Des Weiteren begrenzen Sicherheitenvereinbarungen das Ausmaß, in dem Verbindlichkeiten an den Fonds ausgedehnt werden können. Darüber hinaus steht dem Fonds, wie in Anmerkung 19 dargestellt, eine zugesagte Liquiditätsfazilität zur Verfügung.

*Finanzielle Verbindlichkeiten*

Die Fälligkeitsgruppierung basiert auf der Restlaufzeit ab dem Ende des Berichtszeitraums bis zum vertraglichen Fälligkeitsdatum. Kann die Gegenpartei den Zahlungszeitpunkt auswählen, wird die Verbindlichkeit dem frühestmöglichen Zeitpunkt zugeordnet, zu dem der Fonds zur Zahlung aufgefordert werden kann.

Zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 war die überwiegende Mehrheit der Verbindlichkeiten aller Portfolios innerhalb eines Monats zahlbar. Zu den Fälligkeiten der derivativen finanziellen Verbindlichkeiten sehen Sie bitte die Aufstellung des Wertpapierbestands. Andere Verbindlichkeiten als derivative finanzielle Verbindlichkeiten sind innerhalb eines Monats fällig.

**(f) Risiko im Zusammenhang mit dem Austausch des LIBOR**

Viele Finanzinstrumente verwenden oder können einen variablen Zins auf Grundlage der London Interbank Offered Rate („LIBOR“) verwenden, der Referenzzinssatz, zu dem große internationale Banken ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können. LIBOR ist eventuell ein wesentlicher Faktor bei der Bestimmung der Zahlungsverpflichtungen eines Fonds im Rahmen einer derivativen Anlage, den Finanzierungskosten des Fonds oder eines Wertes oder einer Rendite einer Anlage im Fond und kann eventuell auf eine andere Art und Weise verwendet werden, die die Anlageperformance des Fonds beeinflusst. Die Financial Conduct Authority des Vereinigten Königreichs gab das Auslaufen des LIBORS bekannt. Auch wenn viele LIBOR-Sätze ausliefen, wird bis Juni 2023 weiter eine Auswahl weit genutzter USD-LIBOR-Sätze veröffentlicht, um den Übergang zu erleichtern. Die Portfolios gehen eventuell Engagements in an den LIBOR gebundene Finanzinstrumente ein, um Zahlungsverpflichtungen, Finanzierungsbedingungen, Absicherungsstrategien oder den Anlagewert zu bestimmen. Der Übergang weg vom LIBOR könnte zu einer erhöhten Volatilität und Illiquidität an Märkten für Instrumente führen, deren Bedingungen aktuell den LIBOR enthalten und die Effizienz neuer abgeschlossener Absicherungen mindern.

**(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen**

FRS 102 Section 11.27 zum „Zeitwert: Offenlegung“ erfordert die Offenlegung in Bezug auf die Zeitwerthierarchie, in der Zeitwertbewertungen für Aktiva und Passiva kategorisiert sind. Die Offenlegungen basieren auf einer Zeitwerthierarchie mit drei Stufen für die Eingangswerte, die zur Bewertung des Zeitwerts in Bewertungstechniken verwendet werden.

Der Fonds legt der Bewertung nach dem beizulegenden Zeitwert eine Zeitwerthierarchie zu Grunde, die die Bedeutung der zur Bewertung herangezogenen Parameter berücksichtigt. Die drei Stufen der Zeitwerthierarchie gemäß FRS 102 werden nachstehend beschrieben:

Stufe 1 – Unangepasste, auf aktiven Märkten notierte Preise, die zum Bewertungszeitpunkt für identische, unbeschränkte Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten verfügbar sind.

Stufe 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Preise) oder indirekt (d. h. abgeleitet aus Preisen) beobachtbar sind und die nicht der Stufe 1 angehören.

Stufe 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (d. h. nicht beobachtbare Parameter). Nicht beobachtbare Preisparameter werden bei Anlagen und in Situationen herangezogen, bei denen keine oder nur eine geringe Marktaktivität für das Instrument vorhanden ist. Die zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts herangezogenen Parameter erfordern ein hohes Maß an Verwaltung, Beurteilung und Schätzung. Da für diese Wertpapiere keine beobachtbaren Preise verfügbar sind, hätten die Portfolios gegebenenfalls Bewertungstechniken angewandt, um dem beizulegenden Zeitwert zu ermitteln.

Die Stufe in der Zeitwerthierarchie, der die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit eines Parameters anhand der Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden zum Beispiel bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter angewandt, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so ist diese Bewertung der Stufe 3 zuzuordnen.

Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)**

**(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

Die Entscheidung, was als „beobachtbar“ gilt, erfordert ein beträchtliches Urteilsvermögen seitens der Direktoren in Konsultation mit dem Manager.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in Aktien, börsengehandelten Indexfonds, Optionsscheinen und ge- und verkauften börsengehandelten Optionen, für die Marktnotierungen zugänglich sind, wird in der Regel durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage des letzten an einer Hauptbörse oder einem Hauptmarkt für dieses Wertpapier notierten Verkaufspreises ermittelt (Parameter der Stufe 1). An der NASDAQ gehandelte Wertpapiere werden normalerweise mit dem offiziellen NASDAQ-Schlusskurs („NOCP“) bewertet, der von der NASDAQ an jedem Geschäftstag bereitgestellt wird. Der NOCP ist der zuletzt gemeldete Kurs um 16:00:02 Uhr, Eastern Time, außer wenn dieser Kurs außerhalb der „internen“ Geld- und Briefkursspanne (d. h. der Geld- und Briefkurse, die sich die Händler gegenseitig beim Handel für ihre eigenen Konten nennen) liegt. In diesem Fall passt die NASDAQ den Kurs so an, dass er dem internen Geld- oder Briefkurs entspricht, je nachdem, welcher näher liegt. Aufgrund von Verzögerungen bei der Meldung von Transaktionen basiert der NOCP möglicherweise nicht auf dem Preis des letzten Geschäfts vor dem Marktschluss. Wenn es an einem bestimmten Tag keinen Verkauf eines Wertpapiers gibt, können die unabhängigen Pricing-Service-Anbieter das Wertpapier auf der Grundlage von Marktnotierungen bewerten.

Der Wert von Participatory Notes wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf der zugrunde liegenden Aktien und dem anwendbaren Wechselkurs basieren (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert der Anlagen des Portfolios in Schuldtiteln wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage zugänglicher Mittelkurse bestimmt. Falls keine solchen verfügbar sind, werden Methoden genutzt, die verschiedene Überlegungen auf der Grundlage des Wertpapiertyps beinhalten (allgemein Inputfaktoren der Stufe 2). Wenn mehr als eine Marktnotierung für ein Wertpapier verfügbar ist, wird das Wertpapier auf Stufe 2 eingestuft. Neben der Berücksichtigung von Renditen oder Kursen von Wertpapieren vergleichbarer Qualität, des Kupons, der Laufzeit und des Typs, von Hinweisen auf Werte von Händlern und der allgemeinen Marktbedingungen werden im Folgenden weitere Parameter der Stufe 2 und damit verbundene Bewertungstechniken beschrieben, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zur Bewertung bestimmter Arten, von den Portfolios gehaltenen Schuldtiteln verwendet werden:

*Unternehmensanleihen.* Zu den Parametern, die für die Bewertung von Unternehmensanleihen verwendet werden, gehören im Allgemeinen relevante Kreditinformationen, beobachtete Marktbewegungen, sektorrelevante Nachrichten, die Renditekurve der US-Staatsanleihen oder die relevante Benchmark-Renditekurve sowie andere Marktinformationen, zu denen die Renditekurve der Benchmark, gemeldete Transaktionen, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, vergleichbare Wertpapiere und Referenzdaten, wie z. B. verfügbar Veröffentlichtungen im Bereich der Marktforschung („andere Marktinformationen“).

*Wandelanleihen.* Die zur Bewertung von Wandelanleihen (einschließlich CoCos) herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Daten zu den zugrunde liegenden Aktien, Wandelprämien, Kurse börsennotierter Anleihen und Vorzugsaktien und andere Marktinformationen. Darunter können gegebenenfalls Benchmarkkurven, Transaktionsausführungsdaten und Sensitivitätsanalysen sein.

*US-Staatsanleihen.* Die zur Bewertung von US-Staatsanleihen herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Notierungen verschiedener Inter-Dealer-Broker und andere Marktinformationen.

*Quasistaatliche US-Wertpapiere.* Die zur Bewertung quasistaatlicher US-Wertpapiere herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich das Einholen von Benchmark-Notierungen und andere Marktinformationen.

*Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS) und hypothekarisch besicherte Wertpapiere (MBS).* Zu den Parametern, die für die Bewertung von forderungsbesicherten Wertpapieren und hypothekarisch besicherten Wertpapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe von Faktoren berücksichtigen, darunter: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen.

*Hochzinstitel.* Zu den Parametern, die für die Bewertung von Hochzinstiteln verwendet werden, gehören im Allgemeinen eine Reihe von emittentenbezogenen Beobachtungen von Aktien- und Credit-Default-Swap-Kurven sowie sonstige Marktinformationen.

*Schwellenländeranleihen und ausländische Staatsanleihen.* Zu den Parametern, die für die Bewertung von Schuldtiteln aus Schwellenländern und ausländischen Staatspapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Händlernoteierungen, Anleihemarktaktivitäten, diskontierte Cashflow-Modelle und andere relevante Informationen wie Kreditspreads, Benchmarkkurven und andere Marktinformationen.

*Besicherte Schuldtitel (Collateralized Loan Obligations, CLOs).* Der Wert besicherter Schuldtiteln wird vorrangig durch Cashflow-Daten, relevante Daten zur Preisgestaltung von Darlehen und Marktfarben (Informationen, die für ein Unternehmen, eine Branche oder einen Markt spezifischer sind als öffentliche Informationen) sowie durch das Research von Marktteilnehmern und Trading Desks bestimmt (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Laufzeitkrediten wird in erster Linie durch Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage von Broker-Quotierungen ermittelt (im Allgemeinen Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3, je nach Anzahl der verfügbaren Quotierungen).

Der Wert von Futures-Kontrakten wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert von Devisenterminkontrakten wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf tatsächlich gehandelten Währungskursen in den Netzwerken dieser unabhängigen Dienste sowie auf anderen gehandelten und notierten Währungskursen basieren, die den Pricing-Service-Anbietern von führenden Marktteilnehmern zur Verfügung gestellt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

**12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

Der Wert von Credit Default Swaps wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden. Dabei kommt ein Modell zum Einsatz, das eine Reihe von Faktoren berücksichtigt, darunter möglicherweise Ausfallwahrscheinlichkeiten, Kreditkurven, Wiedereinbringungsquoten und Cashflows (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Inflationsswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter unter Bezugnahme auf die zugrunde liegenden Inflationsraten einschließlich der prognostizierten erwarteten Inflationsrate und der jeweiligen Interbank Offered Forward Rate für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Inflationserwartungskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Zinsswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter auf der Grundlage von Referenzen zu den zugrunde liegenden Sätzen einschließlich des lokalen OIS (Overnight Index Swap) und des jeweiligen IBOR (Interbank Offered Forward) für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Total Return Swaps wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern unter Verwendung des zugrunde liegenden Vermögenswerts und des angegebenen Zinssatzes der Benchmark eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Cross-Currency-Swaps wird durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter anhand des Barwerts der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Volatility-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf einem vorab festgestellten Volatilitätsniveau gegenüber der tatsächlichen, über einen gewissen Zeitraum realisierten Volatilität auf Grundlage von Daten des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Variance-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der in der Vergangenheit realisierten und der voraussichtlichen künftigen Varianz (oder fairen Varianz) des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Correlation-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der Differenzen zwischen der realisierten Korrelation und einem festen Korrelationswert (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Differenzkontrakten („CFD“) wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter ermittelt, die auf der Bezugnahme auf den zugrunde liegenden Vermögenswert sowie den angegebenen Referenzzinssatz beruhen (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Swaptions wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern oder von Gegenparteien zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Optionskontrakte, die im Freiverkehr gehandelt werden, werden generell auf der Grundlage von Notierungen bewertet, die von Broker-Dealern gestellt werden, oder von Preisen, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellt werden, welche eine Reihe von Methoden einsetzen, unter anderem simulierte Preismodelle und/oder Kurvenanpassung (Bootstrapping), was die Ermittlung des Barwerts der Kontrakte erleichtert. Die Preismodelle ziehen Parameter heran, die auf aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie Angaben zum Emittenten, Indizes, Spreads, Zinssätze, Renditekurven, Volatilitätsoberflächen und Wechselkurse (Inputfaktoren der Stufe 2).

Einlagenzertifikate werden zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet (Parameter der Stufe 2).

Umgekehrte Pensionsgeschäfte werden von Pricing-Service-Anbietern zum Nennwert bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Manager hat einen Prozess entwickelt, um die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellten Informationen für alle Arten von Wertpapieren regelmäßig zu überprüfen.

Anlagen in nicht börsengehandelte Investmentgesellschaften werden anhand des täglich berechneten Nettoinventarwerts („NIW“) pro Anteil des jeweiligen Fonds bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2), sofern verfügbar.

Wenn keine Bewertung von einem unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verfügbar ist oder wenn der Manager Grund zu der Annahme hat, dass die erhaltene Bewertung nicht dem Betrag entspricht, den ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf in einer ordnungsgemäßen Transaktion vernünftigerweise erwarten könnte, versucht der Manager, Quotierungen von Brokern oder Händlern einzuholen (sie werden im Allgemeinen je nach der Anzahl der verfügbaren Angebote als Inputfaktoren der Stufe 2 oder der Stufe 3 erachtet). Wenn solche Quotierungen nicht verfügbar sind, wird das Wertpapier anhand von Methoden bewertet, welche die Direktoren in dem guten Glauben genehmigt haben, dass die resultierende Bewertung den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers widerspiegelt.

Parameter und Annahmen, die bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Wertpapiers auf der Grundlage von Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3 berücksichtigt werden, gehören unter anderem die Art des Wertpapiers, die Anschaffungskosten des Wertpapiers, das Vorhandensein vertraglicher Beschränkungen für die Veräußerung des Wertpapiers, der Preis und der Umfang des öffentlichen Handels mit ähnlichen Wertpapieren des Emittenten oder vergleichbarer Unternehmen; Notierungen oder bewertete Preise von Broker-Dealern und/oder Pricing-Service-Anbietern; Informationen, die vom Emittenten und/oder von Analysten eingeholt wurden; eine Analyse der Jahresabschlüsse des Unternehmens oder des Emittenten; eine Bewertung der Parameter, die den Emittenten beeinflussen, und des Marktes/der Märkte, auf dem/denen das Wertpapier gekauft und verkauft wird.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Der Wert der Anlagen der Portfolios in ausländischen Wertpapieren wird in der Regel mit denselben Bewertungsmethoden und Parametern wie bei anderen Portfolioanlagen und wie oben beschrieben bestimmt. Die in Landeswährung ausgedrückten Preise ausländischer Wertpapiere werden normalerweise von der Landeswährung in US-Dollar umgerechnet. Dabei werden die Wechselkurse um 16:00 Uhr Eastern Time an Tagen verwendet, an denen die New York Stock Exchange („NYSE“) für den Geschäftsverkehr geöffnet ist. Die Direktoren haben die Inanspruchnahme der Interactive Data Pricing & Reference Data LLC („ICE“) genehmigt, um bei der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts ausländischer Dividendenpapiere mitzuwirken, wenn Änderungen im Wert eines bestimmten Index andeuten, dass die Schlusskurse an den ausländischen Börsen ggf. nicht länger repräsentativ für den Preis sind, den ein Portfolio für diese Wertpapiere oder an Tagen erwarten könnte, wenn ausländische Märkte geschlossen und US-Märkte offen sind. In jedem dieser Fälle liefert ICE mittels einer statistischen Analyse historischer Korrelationen mehrerer Faktoren angepasste Kurse für bestimmte ausländische Dividendenpapiere (Inputfaktoren der Stufe 2). Die Direktoren haben zudem die Verwendung von ICE genehmigt, um die Preise ausländischer Schuldtiteln zu dem Zeitpunkt zu bewerten, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird. ICE verwendet Benchmark-Spread- und Renditekurven und wertet die verfügbaren Marktaktivitäten vom lokalen Börsenschluss bis zu dem Zeitpunkt aus, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird (Inputfaktoren der Stufe 2), um so bei der Ermittlung der Preise bestimmter ausländischer Schuldtitel zu helfen.

Sowohl bei ausländischen Aktien als auch bei ausländischen Schuldtiteln haben die Direktoren Mangels genauer Informationen über die Marktwerte dieser ausländischen Wertpapiere zu dem Zeitpunkt, wenn der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird anhand verfügbarer Daten entschieden, dass auf diese Art und Weise angepasste oder geschätzte Preise wahrscheinlich eher den Preisen entsprechen, die ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf erzielen könnte, als die Preise derjenigen Wertpapiere, die bei Börsenschluss der ausländischen Märkte ermittelt werden, auf denen die Wertpapiere vorwiegend gehandelt werden.

Preise zum beizulegenden Zeitwert sind notwendigerweise Schätzungen. Es gibt keine Gewähr, dass ein solcher Preis dem tatsächlichen Preis, zu dem das Wertpapier als nächstes notiert oder gehandelt wird, entspricht oder diesem nahe kommt.

Die nachstehenden Tabellen zeigen Finanzanlagen nach den Stufen in der Zeitwerthierarchie:

5G Connectivity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	884.202.753	68.691.966	–	952.894.719
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.141.765	–	12.141.765
<b>Insgesamt</b>	<b>884.202.753</b>	<b>80.833.731</b>	<b>–</b>	<b>965.036.484</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		(3.280.059)		(3.280.059)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(3.280.059)</b>	<b>–</b>	<b>(3.280.059)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## 5G Connectivity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	1.734.984.352	593.106.215	–	2.328.090.567
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.155.281	–	1.155.281
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.734.984.352</b>	<b>594.261.496</b>	<b>–</b>	<b>2.329.245.848</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(5.949.073)	–	(5.949.073)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(5.949.073)</b>	<b>–</b>	<b>(5.949.073)</b>

## Absolute Return Multi Strategy\*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3** US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	–	–	6.766	6.766
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.766</b>	<b>6.766</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3** US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	–	–	31.388	31.388
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>31.388</b>	<b>31.388</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(11.507)	–	(11.507)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(11.507)</b>	<b>–</b>	<b>(11.507)</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Aktien der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Asian Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	18.090.069	–	18.090.069
Staatsanleihen	–	2.090.986	–	2.090.986
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	34.382	–	34.382
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	47.079	–	–	47.079
<b>Insgesamt</b>	<b>47.079</b>	<b>20.215.437</b>	<b>–</b>	<b>20.262.516</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(84.733)	–	(84.733)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(3.440)	–	–	(3.440)
<b>Insgesamt</b>	<b>(3.440)</b>	<b>(84.733)</b>	<b>–</b>	<b>(88.173)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	12.557.968	–	12.557.968
Staatsanleihen	–	1.499.303	–	1.499.303
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.320	–	12.320
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	16.283	–	–	16.283
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	6.312	–	6.312
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>16.283</b>	<b>14.075.903</b>	<b>–</b>	<b>14.092.186</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(9.164)	–	(9.164)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(25.555)	–	–	(25.555)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(1.404)	–	(1.404)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(25.555)</b>	<b>(10.568)</b>	<b>–</b>	<b>(36.123)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## China A-Share Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	15.264.413	53.280	–	15.317.693
<b>Insgesamt</b>	<b>15.264.413</b>	<b>53.280</b>	<b>–</b>	<b>15.317.693</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	23.719.184	–	–	23.719.184
<b>Insgesamt</b>	<b>23.719.184</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>23.719.184</b>

## China Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	272.165.839	–	272.165.839
Einlagenzertifikate	–	92.924.345	–	92.924.345
Staatsanleihen	–	60.073.670	–	60.073.670
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.921.557	–	3.921.557
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>429.085.411</b>	<b>–</b>	<b>429.085.411</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		(2.701.843)		(2.701.843)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(37.837)	–	–	(37.837)
<b>Insgesamt</b>	<b>(37.837)</b>	<b>(2.701.843)</b>	<b>–</b>	<b>(2.739.680)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

China Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
<b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>				
Einlagenzertifikate	–	38.863.400	–	38.863.400
Unternehmensanleihen	–	385.785.879	–	385.785.879
Staatsanleihen	–	119.228.610	–	119.228.610
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.173.424	–	2.173.424
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>546.051.313</b>	<b>–</b>	<b>546.051.313</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
<b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.788.624)	–	(2.788.624)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(414.680)	–	–	(414.680)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(414.680)</b>	<b>(2.788.624)</b>	<b>–</b>	<b>(3.203.304)</b>

China Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
<b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>				
Aktien	306.849.688	–	–	306.849.688
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.099.861	–	1.099.861
<b>Insgesamt</b>	<b>306.849.688</b>	<b>1.099.861</b>	<b>–</b>	<b>307.949.549</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
<b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(817.712)	–	(817.712)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(817.712)</b>	<b>–</b>	<b>(817.712)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## China Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	503.367.414	–	–	503.367.414
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	196.873	–	196.873
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>503.367.414</b>	<b>196.873</b>	<b>–</b>	<b>503.564.287</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(268.158)	–	(268.158)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(268.158)</b>	<b>–</b>	<b>(268.158)</b>

## CLO Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	112.870.953	–	112.870.953
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.267.421	–	3.267.421
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>116.138.374</b>	<b>–</b>	<b>116.138.374</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(989.846)	–	(989.846)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(334.323)	–	(334.323)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(1.324.169)</b>	<b>–</b>	<b>(1.324.169)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

CLO Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	133.274.949	–	133.274.949
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	60.610	–	60.610
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	92.446	–	92.446
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>133.428.005</b>	<b>–</b>	<b>133.428.005</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(698.215)	–	(698.215)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(698.215)</b>	<b>–</b>	<b>(698.215)</b>

Commodities<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	10.530.836	–	10.530.836
Unternehmensanleihen	–	26.223.262	–	26.223.262
Schatzwechsel	–	39.453.874	–	39.453.874
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.519.496	–	1.519.496
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	0	–	0
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>77.727.468</b>	<b>–</b>	<b>77.727.468</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(333.046)	–	(333.046)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(333.046)</b>	<b>–</b>	<b>(333.046)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Corporate Hybrid Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	1.638.001.345	–	1.638.001.345
Investmentfonds	–	10.317.170	–	10.317.170
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	36.511.573	–	36.511.573
<b>Insgesamt</b>	–	<b>1.684.830.088</b>	–	<b>1.684.830.088</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	–	(37.445.575)	–	(37.445.575)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(20.223.334)	–	(20.223.334)
<b>Insgesamt</b>	–	<b>(57.668.909)</b>	–	<b>(57.668.909)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	2.250.494.338	–	2.250.494.338
Investmentfonds	–	11.305.839	–	11.305.839
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	13.732.395	–	13.732.395
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	–	<b>2.275.532.572</b>	–	<b>2.275.532.572</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(15.718.355)	–	(15.718.355)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	–	<b>(15.718.355)</b>	–	<b>(15.718.355)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	784.977.470	–	784.977.470
Staatsanleihen	–	1.508.020.941	–	1.508.020.941
Investmentfonds	–	16.110.000	–	16.110.000
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.379.899	–	12.379.899
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	23.148.647	–	–	23.148.647
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.909.636	–	1.909.636
<b>Insgesamt</b>	<b>23.148.647</b>	<b>2.323.397.946</b>	<b>–</b>	<b>2.346.546.593</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(10.560.096)	–	(10.560.096)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.308.787)	–	–	(1.308.787)
<b>Insgesamt</b>	<b>(1.308.787)</b>	<b>(10.560.096)</b>	<b>–</b>	<b>(11.868.883)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	1.162.113.940	–	1.162.113.940
Staatsanleihen	–	2.239.293.074	–	2.239.293.074
Investmentfonds	–	16.683.000	–	16.683.000
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.483.572	–	12.483.572
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	14.326.208	–	–	14.326.208
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>14.326.208</b>	<b>3.430.573.586</b>	<b>–</b>	<b>3.444.899.794</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.972.040)	–	(1.972.040)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(640.953)	–	–	(640.953)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(640.953)</b>	<b>(1.972.040)</b>	<b>–</b>	<b>(2.612.993)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Local Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Einlagenzertifikat	–	18.492.177	–	18.492.177
Unternehmensanleihen	–	22.468.723	–	22.468.723
Staatsanleihen	–	1.280.353.016	–	1.280.353.016
Investmentfonds	–	15.136.550	–	15.136.550
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	14.987.459	–	14.987.459
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	8.845.584	–	8.845.584
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>1.360.283.509</b>	<b>–</b>	<b>1.360.283.509</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(9.665.447)	–	(9.665.447)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(676.393)	–	–	(676.393)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(47.106.454)	–	(47.106.454)
<b>Insgesamt</b>	<b>(676.393)</b>	<b>(56.771.901)</b>	<b>–</b>	<b>(57.448.294)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	33.373.484	–	33.373.484
Staatsanleihen	–	1.796.211.686	–	1.796.211.686
Investmentfonds	–	16.157.350	–	16.157.350
Schatzwechsel	–	86.921.689	–	86.921.689
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	16.632.554	–	16.632.554
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	15.018.402	–	15.018.402
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>1.964.315.165</b>	<b>–</b>	<b>1.964.315.165</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(7.881.956)	–	(7.881.956)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(156.313)	–	–	(156.313)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(54.766.239)	–	(54.766.239)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(156.313)</b>	<b>(62.648.195)</b>	<b>–</b>	<b>(62.804.508)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	149.902.253	–	149.902.253
Staatsanleihen	–	288.112.593	–	288.112.593
Investmentfonds	–	13.380.558	–	13.380.558
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	4.031.358	–	4.031.358
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.175.800	–	–	1.175.800
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.658.685	–	1.658.685
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	4.841.085	–	4.841.085
<b>Insgesamt</b>	<b>1.175.800</b>	<b>461.926.532</b>	<b>–</b>	<b>463.102.332</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.058.976)	–	(2.058.976)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(159.705)	–	–	(159.705)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(11.561.405)	–	(11.561.405)
<b>Insgesamt</b>	<b>(159.705)</b>	<b>(13.620.381)</b>	<b>–</b>	<b>(13.780.086)</b>

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	7.512.041	–	7.512.041
Staatsanleihen	–	42.285.874	–	42.285.874
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	446.879	–	446.879
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	610.127	–	–	610.127
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	43.385	–	43.385
<b>Insgesamt</b>	<b>610.127</b>	<b>50.288.179</b>	<b>–</b>	<b>50.898.306</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		(340.697)		(340.697)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(65.989)	–	–	(65.989)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(135.722)	–	(135.722)
<b>Insgesamt</b>	<b>(65.989)</b>	<b>(476.419)</b>	<b>–</b>	<b>(542.408)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	9.721.900	–	9.721.900
Staatsanleihen	–	31.953.570	–	31.953.570
Schatzwechsel	–	1.676.064	–	1.676.064
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	606.096	–	606.096
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	258.703	–	–	258.703
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	27.541	–	27.541
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>258.703</b>	<b>43.985.171</b>	<b>–</b>	<b>44.243.874</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(96.215)	–	(96.215)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(10.209)	–	–	(10.209)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(170.977)	–	(170.977)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(10.209)</b>	<b>(267.192)</b>	<b>–</b>	<b>(277.401)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Markets Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	139.636.822	49.097.184	–	188.734.006
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.053.813	–	1.053.813
<b>Insgesamt</b>	<b>139.636.822</b>	<b>50.150.997</b>	<b>–</b>	<b>189.787.819</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(666.859)	–	(666.859)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(666.859)</b>	<b>–</b>	<b>(666.859)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	271.208.128	106.751.192	–	377.959.320
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	478.323	–	478.323
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>271.208.128</b>	<b>107.229.515</b>	<b>–</b>	<b>378.437.643</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(688.813)	–	(688.813)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(688.813)</b>	<b>–</b>	<b>(688.813)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Markets Select Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	67.247.423	23.179.556	–	90.426.979
<b>Insgesamt</b>	<b>67.247.423</b>	<b>23.179.556</b>	<b>–</b>	<b>90.426.979</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	72.518.478	50.648.681	–	123.167.159
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>72.518.478</b>	<b>50.648.681</b>	<b>–</b>	<b>123.167.159</b>

## Euro Bond Absolute Return

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	2.319.216	–	2.319.216
Unternehmensanleihen	–	23.938.251	–	23.938.251
Staatsanleihen	–	19.650.553	–	19.650.553
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	61.989	–	61.989
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	39.745	–	39.745
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.497.736	–	–	1.497.736
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	12.884	–	12.884
<b>Insgesamt</b>	<b>1.497.736</b>	<b>46.022.638</b>	<b>–</b>	<b>47.520.374</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(67.569)	–	(67.569)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.032.074)	–	(1.032.074)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(103.516)	–	–	(103.516)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(32.637)	–	(32.637)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(43.820)	–	(43.820)
<b>Insgesamt</b>	<b>(103.516)</b>	<b>(1.176.100)</b>	<b>–</b>	<b>(1.279.616)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

**Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	2.053.891	–	2.053.891
Unternehmensanleihen	–	17.300.482	–	17.300.482
Staatsanleihen	–	29.296.725	–	29.296.725
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	221.198	–	221.198
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	434.145	–	–	434.145
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	73.191	–	73.191
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	108.483	–	108.483
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>434.145</b>	<b>49.053.970</b>	<b>–</b>	<b>49.488.115</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(13.326)	–	(13.326)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(21.403)	–	–	(21.403)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(472.208)	–	(472.208)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(11.906)	–	(11.906)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(21.403)</b>	<b>(497.440)</b>	<b>–</b>	<b>(518.843)</b>

**Euro Opportunistic Bond**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	462.816	–	462.816
Unternehmensanleihen	–	4.079.176	–	4.079.176
Staatsanleihen	–	4.005.023	–	4.005.023
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	93	–	93
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	41.432	–	–	41.432
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	1.858	–	1.858
<b>Insgesamt</b>	<b>41.432</b>	<b>8.548.966</b>	<b>–</b>	<b>8.590.398</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Euro Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(82.010)	–	–	(82.010)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(6.528)	–	(6.528)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(23.909)	–	(23.909)
<b>Insgesamt</b>	<b>(82.010)</b>	<b>(30.437)</b>	<b>–</b>	<b>(112.447)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	298.264	–	298.264
Unternehmensanleihen	–	4.427.757	–	4.427.757
Staatsanleihen	–	5.718.588	–	5.718.588
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	28.229	–	–	28.229
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	19.730	–	19.730
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	3.311	–	3.311
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>28.229</b>	<b>10.467.650</b>	<b>–</b>	<b>10.495.879</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(3.370)	–	–	(3.370)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(106.247)	–	(106.247)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(3.370)</b>	<b>(106.247)</b>	<b>–</b>	<b>(109.617)</b>

## European High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	215.121	–	215.121
Unternehmensanleihen	–	32.065.000	–	32.065.000
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	202.519	–	202.519
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.258.544	–	1.258.544
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>33.741.184</b>	<b>–</b>	<b>33.741.184</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.113.019)	–	(3.113.019)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(3.113.019)</b>	<b>–</b>	<b>(3.113.019)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	219.984	–	219.984
Unternehmensanleihen	–	36.562.368	–	36.562.368
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	211.251	–	211.251
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	777.070	–	777.070
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>37.770.673</b>	<b>–</b>	<b>37.770.673</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		(320.550)		(320.550)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(320.550)</b>	<b>–</b>	<b>(320.550)</b>

European Sustainable Equity<sup>2</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	40.367.498	134.021.329	–	174.388.827
<b>Insgesamt</b>	<b>40.367.498</b>	<b>134.021.329</b>	<b>–</b>	<b>174.388.827</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	61.545.444	48.871.498	–	110.416.942
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>61.545.444</b>	<b>48.871.498</b>	<b>–</b>	<b>110.416.942</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Event Driven<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	33.823.354	–	33.823.354
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	918.069	–	918.069
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	18.364	–	18.364
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>34.759.787</b>	<b>–</b>	<b>34.759.787</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		(18.616)		(18.616)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(18.616)</b>	<b>–</b>	<b>(18.616)</b>

## Global Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	2.423.190	–	2.423.190
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	8.861.707	–	8.861.707
Unternehmensanleihen	–	44.359.194	–	44.359.194
Staatsanleihen	–	53.670.009	–	53.670.009
Mortgage-Backed Securities	–	19.062.981	–	19.062.981
Kommunalanleihen	–	1.706.806	–	1.706.806
Schatzwechsel	–	791.814	–	791.814
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.638.428	–	2.638.428
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	270.257	–	–	270.257
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	1.233	–	1.233
<b>Insgesamt</b>	<b>270.257</b>	<b>133.515.362</b>	<b>–</b>	<b>133.785.619</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		(1.908.377)		(1.908.377)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(191.230)	–	–	(191.230)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(13.185)	–	(13.185)
<b>Insgesamt</b>	<b>(191.230)</b>	<b>(1.921.562)</b>	<b>–</b>	<b>(2.112.792)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
<b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>				
Agency Bonds	–	2.795.723	–	2.795.723
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	15.793.186	–	15.793.186
Unternehmensanleihen	–	52.968.088	–	52.968.088
Staatsanleihen	–	82.196.271	–	82.196.271
Mortgage-Backed Securities	–	18.239.492	–	18.239.492
Schatzwechsel	–	1.399.195	–	1.399.195
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.109.117	–	1.109.117
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	34.796	–	–	34.796
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	6.541	–	6.541
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	77.785	–	77.785
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>34.796</b>	<b>174.585.398</b>	<b>–</b>	<b>174.620.194</b>

**Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten**

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(779.807)	–	(779.807)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(387.582)	–	–	(387.582)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(28.500)	–	(28.500)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(387.582)</b>	<b>(808.307)</b>	<b>–</b>	<b>(1.195.889)</b>

Global Diversified Income FMP – 2024

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	150.336.737	–	150.336.737
Staatsanleihen	–	3.931.136	–	3.931.136
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	523.987	–	523.987
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>154.791.860</b>	<b>–</b>	<b>154.791.860</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(417)	–	(417)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(417)</b>	<b>–</b>	<b>(417)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	206.932.749	–	206.932.749
Staatsanleihen	–	11.000.752	–	11.000.752
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	23.493	–	23.493
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>217.956.994</b>	<b>–</b>	<b>217.956.994</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(76.865)	–	(76.865)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(76.865)</b>	<b>–</b>	<b>(76.865)</b>

## Global Equity Megatrends

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	75.013.478	4.451.857	–	79.465.335
<b>Insgesamt</b>	<b>75.013.478</b>	<b>4.451.857</b>	<b>–</b>	<b>79.465.335</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	81.955.406	–	–	81.955.406
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>81.955.406</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>81.955.406</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	24.079.041	–	24.079.041
Unternehmensanleihen	–	316.164.124	–	316.164.124
Aktien	–	–	5.247.334	5.247.334
Staatsanleihen	–	9.817.787	–	9.817.787
Investmentfonds	338.564	–	–	338.564
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	29.033.515	–	29.033.515
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	468.202	–	–	468.202
<b>Insgesamt</b>	<b>806.766</b>	<b>379.094.467</b>	<b>5.247.334</b>	<b>385.148.567</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(10.857.921)	–	(10.857.921)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(515.955)	–	–	(515.955)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(632.100)	–	(632.100)
<b>Insgesamt</b>	<b>(515.955)</b>	<b>(11.490.021)</b>	<b>–</b>	<b>(12.005.976)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	18.193.868	–	18.193.868
Unternehmensanleihen	–	580.860.589	–	580.860.589
Staatsanleihen	–	12.778.898	–	12.778.898
Investmentfonds	474.751	–	–	474.751
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.927.621	–	1.927.621
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	588.178	–	588.178
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	214.191	–	214.191
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>474.751</b>	<b>614.563.345</b>	<b>–</b>	<b>615.038.096</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.100.807)	–	(3.100.807)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(2.372.969)	–	–	(2.372.969)
Verkaufte Swaptionen	–	(4.894)	–	(4.894)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(2.372.969)</b>	<b>(3.105.701)</b>	<b>–</b>	<b>(5.478.670)</b>

## Global High Yield SDG Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	273.005.334	–	273.005.334
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	687.601	325.875	1.013.476
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.873.530	–	12.873.530
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	13.411	–	13.411
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>286.579.876</b>	<b>325.875</b>	<b>286.905.751</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(9.426.254)	–	(9.426.254)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(9.426.254)</b>	<b>–</b>	<b>(9.426.254)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	1.002.292	–	1.002.292
Unternehmensanleihen	–	37.832.101	–	37.832.101
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	617.850	–	617.850
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>39.452.243</b>	<b>–</b>	<b>39.452.243</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(951.937)	–	(951.937)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(951.937)</b>	<b>–</b>	<b>(951.937)</b>

Global High Yield Sustainable Action

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	14.443.671	–	14.443.671
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	95.881	–	95.881
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	7.620	–	7.620
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>14.547.172</b>	<b>–</b>	<b>14.547.172</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(358.029)	–	(358.029)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(358.029)</b>	<b>–</b>	<b>(358.029)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	16.768.836	–	16.768.836
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	54.859	–	54.859
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	69.215	–	69.215
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>16.892.910</b>	<b>–</b>	<b>16.892.910</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global High Yield Sustainable Action (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(10.258)	–	(10.258)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(10.258)</b>	<b>–</b>	<b>(10.258)</b>

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	80.767.363	–	80.767.363
Staatsanleihen	–	2.758.010	–	2.758.010
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	16.124	–	16.124
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>83.541.497</b>	<b>–</b>	<b>83.541.497</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.642.819)	–	(1.642.819)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(1.642.819)</b>	<b>–</b>	<b>(1.642.819)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	96.444.446	–	96.444.446
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	464.848	–	464.848
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>96.909.294</b>	<b>–</b>	<b>96.909.294</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(9.663)	–	(9.663)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(9.663)</b>	<b>–</b>	<b>(9.663)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	307.820	–	307.820
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	4.290.102	–	4.290.102
Unternehmensanleihen	–	35.431.699	–	35.431.699
Staatsanleihen	–	24.711.043	–	24.711.043
Investmentfonds	107.216	1.694.000	–	1.801.216
Mortgage-Backed Securities	–	10.458.233	–	10.458.233
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.069.747	–	2.069.747
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	568.616	–	–	568.616
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	455.060	–	455.060
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	17.416	–	17.416
<b>Insgesamt</b>	<b>675.832</b>	<b>79.435.120</b>	<b>–</b>	<b>80.110.952</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(4.857.533)	–	(4.857.533)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(607.164)	–	–	(607.164)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(64.729)	–	(64.729)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(141)	–	(141)
<b>Insgesamt</b>	<b>(607.164)</b>	<b>(4.922.403)</b>	<b>–</b>	<b>(5.529.567)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	406.473	–	406.473
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	10.807.801	–	10.807.801
Unternehmensanleihen	–	43.655.885	–	43.655.885
Staatsanleihen	–	25.468.905	–	25.468.905
Investmentfonds	3.776.344	1.978.000	–	5.754.344
Mortgage-Backed Securities	–	6.090.483	–	6.090.483
Schatzwechsel	–	3.123.203	–	3.123.203
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.282.810	–	1.282.810
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	199.754	–	–	199.754
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	52.876	–	52.876
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>3.976.098</b>	<b>92.866.436</b>	<b>–</b>	<b>96.842.534</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(832.806)	–	(832.806)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(312.561)	–	–	(312.561)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(1.634.210)	–	(1.634.210)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(66.303)	–	(66.303)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(312.561)</b>	<b>(2.533.319)</b>	<b>–</b>	<b>(2.845.880)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	5.878.530	967.525	–	6.846.055
Immobilienaktiengesellschaften	26.313.894	4.046.904	–	30.360.798
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	866.015	–	866.015
<b>Insgesamt</b>	<b>32.192.424</b>	<b>5.880.444</b>	<b>–</b>	<b>38.072.868</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(147.763)	–	(147.763)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(147.763)</b>	<b>–</b>	<b>(147.763)</b>

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$
<b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 1</b>			
Immobilienaktiengesellschaften	404.924	–	(404.924)

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Immobilienaktiengesellschaften von Stufe 3 in Stufe 1 übertragen, da die Immobilienaktiengesellschaften die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwenden.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	3.387.899	4.161.859	–	7.549.758
Immobilienaktiengesellschaften	41.465.634	1.177.216	463.450	43.106.300
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	13.335	–	13.335
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>44.853.533</b>	<b>5.352.410</b>	<b>463.450</b>	<b>50.669.393</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(201.281)	–	(201.281)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(201.281)</b>	<b>–</b>	<b>(201.281)</b>

\* Immobiliengesellschaften (REITs) der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Sustainable Equity<sup>2</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	96.654.246	33.870.236	–	130.524.482
<b>Insgesamt</b>	<b>96.654.246</b>	<b>33.870.236</b>	<b>–</b>	<b>130.524.482</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	171.278.723	31.257.823	–	202.536.546
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>171.278.723</b>	<b>31.257.823</b>	<b>–</b>	<b>202.536.546</b>

## High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	21.830.306	–	21.830.306
Unternehmensanleihen	–	1.982.553.426	–	1.982.553.426
Investmentfonds	18.294.706	–	–	18.294.706
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	85.843.814	5.791.687	91.635.501
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	55.707.544	–	55.707.544
<b>Insgesamt</b>	<b>18.294.706</b>	<b>2.145.935.090</b>	<b>5.791.687</b>	<b>2.170.021.483</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(25.192.706)	–	(25.192.706)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(404.963)	–	(404.963)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(25.597.669)</b>	<b>–</b>	<b>(25.597.669)</b>

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$
--	-----------------	-----------------	-----------------

## Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2

Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	13.907.802	(13.907.802)
--------------------------------------	---	------------	--------------

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	43.351.226	–	43.351.226
Unternehmensanleihen	–	2.791.815.047	–	2.791.815.047
Investmentfonds	30.444.245	5.432.387	–	35.876.632
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	140.686.171	26.761.291	167.447.462
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	6.339.440	–	6.339.440
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	658.095	–	658.095
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>30.444.245</b>	<b>2.988.282.366</b>	<b>26.761.291</b>	<b>3.045.487.902</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(25.945.509)	–	(25.945.509)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(25.945.509)</b>	<b>–</b>	<b>(25.945.509)</b>

\* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

InnovAsia 5G<sup>2</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	13.493.208	379.300	–	13.872.508
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	453.339	–	453.339
<b>Insgesamt</b>	<b>13.493.208</b>	<b>832.639</b>	<b>–</b>	<b>14.325.847</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(78.732)	–	(78.732)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(78.732)</b>	<b>–</b>	<b>(78.732)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

InnovAsia 5G<sup>2</sup> (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	8.638.031	17.207.283	–	25.845.314
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	40.740	–	40.740
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>8.638.031</b>	<b>17.248.023</b>	<b>–</b>	<b>25.886.054</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(150.621)	–	(150.621)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(150.621)</b>	<b>–</b>	<b>(150.621)</b>

## Japan Equity Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	20.207.455.300	–	–	20.207.455.300
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	44.531.344	–	44.531.344
<b>Insgesamt</b>	<b>20.207.455.300</b>	<b>44.531.344</b>	<b>–</b>	<b>20.251.986.644</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(141.215.249)	–	(141.215.249)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(141.215.249)</b>	<b>–</b>	<b>(141.215.249)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	13.395.215.072	–	–	13.395.215.072
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	752.199	–	752.199
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>13.395.215.072</b>	<b>752.199</b>	<b>–</b>	<b>13.395.967.271</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(225.405)	–	(225.405)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(225.405)</b>	<b>–</b>	<b>(225.405)</b>

Macro Opportunities FX

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	24.967.521	–	24.967.521
Staatsanleihen	–	2.778.639	–	2.778.639
Schatzwechsel	–	4.389.983	–	4.389.983
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.617.207	–	3.617.207
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>35.753.350</b>	<b>–</b>	<b>35.753.350</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(4.428.576)	–	(4.428.576)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(4.428.576)</b>	<b>–</b>	<b>(4.428.576)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	42.828.912	–	42.828.912
Staatsanleihen	–	200.575	–	200.575
Schatzwechsel	–	2.209.782	–	2.209.782
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.924.532	–	1.924.532
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>47.163.801</b>	<b>–</b>	<b>47.163.801</b>

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.717.109)	–	(2.717.109)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(2.717.109)</b>	<b>–</b>	<b>(2.717.109)</b>

## Multi-Asset Income

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	7.644	–	7.644
Unternehmensanleihen	–	4.880.908	–	4.880.908
Aktien	2.520.628	327.820	–	2.848.448
Staatsanleihen	–	311.601	–	311.601
Investmentfonds	29.623	572.562	–	602.185
Gekaufte Optionskontrakte	4.207	–	–	4.207
Immobilienaktiengesellschaften	364.808	–	–	364.808
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	160.435	–	160.435
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	51.032	–	–	51.032
<b>Insgesamt</b>	<b>2.970.298</b>	<b>6.260.970</b>	<b>–</b>	<b>9.231.268</b>

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(59.717)	–	–	(59.717)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(584.335)	–	(584.335)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(2.994)	–	–	(2.994)
<b>Insgesamt</b>	<b>(62.711)</b>	<b>(584.335)</b>	<b>–</b>	<b>(647.046)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	8.797.485	–	8.797.485
Aktien	5.046.171	1.169.576	–	6.215.747
Staatsanleihen	–	1.293.771	–	1.293.771
Investmentfonds	676.383	808.161	–	1.484.544
Gekaufte Optionskontrakte	2.908	–	76	2.984
Immobilienaktiengesellschaften	1.488.419	–	–	1.488.419
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	148.411	–	148.411
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	16.478	–	–	16.478
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	2.121	–	2.121
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>7.230.359</b>	<b>12.219.525</b>	<b>76</b>	<b>19.449.960</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(19.541)	–	–	(19.541)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(90.067)	–	(90.067)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(9.844)	–	–	(9.844)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(29.385)</b>	<b>(90.067)</b>	<b>–</b>	<b>(119.452)</b>

Alle Optionen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

Next Generation Mobility

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	129.334.927	7.542.858	–	136.877.785
Immobilienaktiengesellschaften	1.522.531	–	–	1.522.531
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	294.328	–	294.328
<b>Insgesamt</b>	<b>130.857.458</b>	<b>7.837.186</b>	<b>–</b>	<b>138.694.644</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(213.661)	–	(213.661)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(213.661)</b>	<b>–</b>	<b>(213.661)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	191.372.290	12.193.569	–	203.565.859
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	8.780	–	8.780
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>191.372.290</b>	<b>12.202.349</b>	<b>–</b>	<b>203.574.639</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(107.390)	–	(107.390)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(107.390)</b>	<b>–</b>	<b>(107.390)</b>

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	6.156.111	1.825.563	–	7.981.674
<b>Insgesamt</b>	<b>6.156.111</b>	<b>1.825.563</b>	<b>–</b>	<b>7.981.674</b>

## Short Duration Emerging Market Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	3.527.185.607	500.000	3.527.685.607
Staatsanleihen	–	1.205.827.702	–	1.205.827.702
Investmentfonds	–	70.347.000	–	70.347.000
Schatzwechsel	–	51.075.667	–	51.075.667
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	46.700.064	–	46.700.064
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>4.901.136.040</b>	<b>500.000</b>	<b>4.901.636.040</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	–	(1.843.240)	–	(1.843.240)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(23.986.773)	–	(23.986.773)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(25.830.013)</b>	<b>–</b>	<b>(25.830.013)</b>

\*Eine Unternehmensanleihe der Stufe 3 wurde in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	
<b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b>				
Unternehmensanleihen	–	(500.000)	500.000	

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	4.774.728.985	–	4.774.728.985
Staatsanleihen	–	1.784.869.281	–	1.784.869.281
Investmentfonds	–	72.849.100	–	72.849.100
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	21.429.031	–	21.429.031
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>6.653.876.397</b>	<b>–</b>	<b>6.653.876.397</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(17.737.158)	–	(17.737.158)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(17.737.158)</b>	<b>–</b>	<b>(17.737.158)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Short Duration High Yield SDG Engagement

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	477.638.711	–	477.638.711
Investmentfonds	1.221.039	–	–	1.221.039
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	23.578.927	–	23.578.927
Schatzwechsel	–	10.810.063	–	10.810.063
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	23.012.144	–	23.012.144
<b>Insgesamt</b>	<b>1.221.039</b>	<b>535.039.845</b>	<b>–</b>	<b>536.260.884</b>

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(5.286.451)	–	(5.286.451)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(5.286.451)</b>	<b>–</b>	<b>(5.286.451)</b>

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	561.613.956	–	561.613.956
Investmentfonds	2.288.465	–	–	2.288.465
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	44.679.912	1.599.050	46.278.962
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.240.239	–	1.240.239
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>2.288.465</b>	<b>607.534.107</b>	<b>1.599.050</b>	<b>611.421.622</b>

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(5.381.257)	–	(5.381.257)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(5.381.257)</b>	<b>–</b>	<b>(5.381.257)</b>

\* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	772.053	–	772.053
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	105.467.359	–	105.467.359
Unternehmensanleihen	–	637.567.177	–	637.567.177
Staatsanleihen	–	243.357.365	–	243.357.365
Investmentfonds	738.685	57.487.152	–	58.225.837
Mortgage-Backed Securities	–	346.893.475	–	346.893.475
Kommunalanleihen	–	20.744.098	–	20.744.098
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	453.664	126.140	579.804
Schatzwechsel	–	8.017.122	–	8.017.122
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	29.520.687	–	29.520.687
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	2.904.814	–	–	2.904.814
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	25.894	–	25.894
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	451.266	–	451.266
<b>Insgesamt</b>	<b>3.643.499</b>	<b>1.450.757.312</b>	<b>126.140</b>	<b>1.454.526.951</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(7.161.491)	–	(7.161.491)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.425.842)	–	–	(1.425.842)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(97.587)	–	(97.587)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(916.187)	–	(916.187)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(3.863.949)	–	(3.863.949)
<b>Insgesamt</b>	<b>(1.425.842)</b>	<b>(12.039.214)</b>	<b>–</b>	<b>(13.465.056)</b>

\* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$
<b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b>			
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	(126.140)	126.140

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da die für die Bewertung dieses Laufzeitkredits verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	1.038.942	–	1.038.942
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	75.102.043	–	75.102.043
Unternehmensanleihen	–	573.071.433	–	573.071.433
Staatsanleihen	–	283.764.634	–	283.764.634
Investmentfonds	1.035.820	64.233.144	–	65.268.964
Mortgage-Backed Securities	–	261.330.721	–	261.330.721
Kommunalanleihen	–	17.076.840	–	17.076.840
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	97.726.572	1.573.993	99.300.565
Schatzwechsel	–	190.052.290	–	190.052.290
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.454.679	–	1.454.679
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.641.510	–	2.641.510
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	650.292	–	–	650.292
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	107.813	–	107.813
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	821.049	–	821.049
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.686.112</b>	<b>1.568.421.670</b>	<b>1.573.993</b>	<b>1.571.681.775</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(5.071.083)	–	(5.071.083)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(4.547.280)	–	–	(4.547.280)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(328.905)	–	(328.905)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(4.547.280)</b>	<b>(5.399.988)</b>	<b>–</b>	<b>(9.947.268)</b>

\* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$
<b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b>			
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	(711.830)	711.830
<b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2</b>			
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	68.132	(68.132)

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da die für die Bewertung dieses Laufzeitkredits verfügbaren Notierungen zurückgegangen sind. Die Übertragung bestimmter Laufzeitkredite von Stufe 3 in Stufe 2 war die Folge eines Anstiegs der verfügbaren Notierungen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	27.495.016	–	27.495.016
Staatsanleihen	–	837.924	–	837.924
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	282.337	–	282.337
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	13.122	–	–	13.122
<b>Insgesamt</b>	<b>13.122</b>	<b>28.615.277</b>	<b>–</b>	<b>28.628.399</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(29.229)	–	(29.229)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(29.229)</b>	<b>–</b>	<b>(29.229)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
<b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>				
Unternehmensanleihen	–	20.977.042	–	20.977.042
Staatsanleihen	–	1.236.942	–	1.236.942
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	2.187	–	–	2.187
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>2.187</b>	<b>22.213.984</b>	<b>–</b>	<b>22.216.171</b>

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	86.982.672	–	86.982.672
Staatsanleihen	–	4.401.408	–	4.401.408
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	853.222	–	853.222
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	49.937	–	–	49.937
<b>Insgesamt</b>	<b>49.937</b>	<b>92.237.302</b>	<b>–</b>	<b>92.287.239</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(134.345)	–	(134.345)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(7.617)	–	–	(7.617)
<b>Insgesamt</b>	<b>(7.617)</b>	<b>(134.345)</b>	<b>–</b>	<b>(141.962)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	138.004.155	–	138.004.155
Staatsanleihen	–	2.837.365	–	2.837.365
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	501.625	–	501.625
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	88.548	–	–	88.548
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>88.548</b>	<b>141.343.145</b>	<b>–</b>	<b>141.431.693</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(45.258)	–	(45.258)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(45.258)</b>	<b>–</b>	<b>(45.258)</b>

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	7.708.197	–	7.708.197
Staatsanleihen	–	136.106.159	–	136.106.159
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.237.337	–	1.237.337
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	2.512.729	–	–	2.512.729
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	53.826	–	53.826
<b>Insgesamt</b>	<b>2.512.729</b>	<b>145.105.519</b>	<b>–</b>	<b>147.618.248</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup> (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(862.058)	–	(862.058)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(46.430)	–	–	(46.430)
<b>Insgesamt</b>	<b>(46.430)</b>	<b>(862.058)</b>	<b>–</b>	<b>(908.488)</b>

Systematic Global Sustainable Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	37.427.578	9.532.811	–	46.960.389
Immobilienaktiengesellschaften	545.905	209.532	–	755.437
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	125.312	–	125.312
<b>Insgesamt</b>	<b>37.973.483</b>	<b>9.867.655</b>	<b>–</b>	<b>47.841.138</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(90.456)	–	(90.456)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(90.456)</b>	<b>–</b>	<b>(90.456)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	15.294.912	3.540.047	–	18.834.959
Investmentfonds	1.618.552	–	–	1.618.552
Immobilienaktiengesellschaften	347.198	–	–	347.198
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	29.635	–	29.635
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>17.260.662</b>	<b>3.569.682</b>	<b>–</b>	<b>20.830.344</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Systematic Global Sustainable Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(40.232)	–	(40.232)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(40.232)</b>	<b>–</b>	<b>(40.232)</b>

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$
<b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 1</b>			
Investmentfonds	814.680	–	(814.680)

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 wurde ein Investmentfonds von Stufe 3 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch den Anbieter erfolgte und die von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren nicht mehr verwendet werden mussten.

## Ultra Short Term Euro Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	72.343.961	–	72.343.961
Unternehmensanleihen	–	670.503.994	–	670.503.994
Staatsanleihen	–	56.450.113	–	56.450.113
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	9.296	–	9.296
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	232.108	–	232.108
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	9.402.701	–	–	9.402.701
<b>Insgesamt</b>	<b>9.402.701</b>	<b>799.539.472</b>	<b>–</b>	<b>808.942.173</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		(6.570.781)		(6.570.781)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.719.108)	–	–	(1.719.108)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(543.950)	–	(543.950)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(1.735.988)	–	(1.735.988)
<b>Insgesamt</b>	<b>(1.719.108)</b>	<b>(8.850.719)</b>	<b>–</b>	<b>(10.569.827)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	146.158.777	–	146.158.777
Unternehmensanleihen	–	828.802.596	–	828.802.596
Staatsanleihen	–	62.415.148	–	62.415.148
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	598.353	–	598.353
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.198.442	–	1.198.442
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	3.514.679	–	–	3.514.679
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>3.514.679</b>	<b>1.039.173.316</b>	<b>–</b>	<b>1.042.687.995</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(228.659)	–	(228.659)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(31.300)	–	–	(31.300)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(3.895.716)	–	(3.895.716)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(31.300)</b>	<b>(4.124.375)</b>	<b>–</b>	<b>(4.155.675)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	161.387.060	–	161.387.060
Aktien	135.368.028	–	–	135.368.028
Staatsanleihen	–	4.218.750	–	4.218.750
Participatory Notes	21.440	–	–	21.440
Immobilienaktiengesellschaften	4.976.282	–	–	4.976.282
Schatzwechsel	–	1.582.793.462	–	1.582.793.462
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	212.294.005	–	212.294.005
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	40.643.851	–	–	40.643.851
Gekaufte Optionskontrakte	73.572.721	128.636.328	551.147	202.760.196
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	78.117.298	714	78.118.012
Gekaufte Swaptions	–	1.388.392	–	1.388.392
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.435.658	–	1.435.658
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	65.682.162	–	65.682.162
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	27.160.802	–	27.160.802
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	3.899.449	–	3.899.449
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	700.944	–	700.944
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	–	971.550	–	971.550
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	32.121.676	–	32.121.676
<b>Insgesamt</b>	<b>254.582.322</b>	<b>2.300.807.536</b>	<b>551.861</b>	<b>2.555.941.719</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(37.812.332)	–	(37.812.332)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(25.288.052)	–	–	(25.288.052)
Verkaufte Optionskontrakte	(25.955.164)	(284.022.074)	(5.880)	(309.983.118)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(58.427.650)	(288.575)	(58.716.225)
Verkaufte Swaptions	–	(708.024)	–	(708.024)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(526.998)	–	(526.998)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(23.945.145)	–	(23.945.145)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(26.861.904)	–	(26.861.904)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(1.242.422)	–	(1.242.422)
Nicht realisierter Verlust aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	(60.576)	–	(60.576)
Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten	–	(421.247)	–	(421.247)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	(4.417.825)	–	(4.417.825)
<b>Insgesamt</b>	<b>(51.243.216)</b>	<b>(438.446.197)</b>	<b>(294.455)</b>	<b>(489.983.868)</b>

\* Optionen und Differenzkontrakte der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$
<b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b>			
Differenzkontrakte	–	215.193	(215.193)
Correlation-Swap-Kontrakte	–	700.944	(700.944)
Aktien	100.661.159	(100.661.159)	–
Participatory Notes	6.404	(6.404)	–
Immobilienaktiengesellschaften	4.976.282	(4.976.282)	–
Volatility-Swap-Kontrakte	–	17.959.222	(17.959.222)

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Correlation Swap-Kontrakte und Volatility Swap-Kontrakte von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwendet werden. Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Aktien, Participatory Notes und Immobilienaktiengesellschaften von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	119.867.609	–	119.867.609
Aktien	16.510.711	–	–	16.510.711
Staatsanleihen	–	11.177.787	–	11.177.787
Investmentfonds	–	10.302.696	–	10.302.696
Participatory Notes	–	12.737	–	12.737
Schatzwechsel	–	859.959.488	–	859.959.488
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	23.765.615	–	23.765.615
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	17.116.984	–	–	17.116.984
Gekaufte Optionskontrakte	40.040.089	210.841.004	534.055	251.415.148
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	130.231.387	–	130.231.387
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	148.731	–	148.731
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	9.827.741	–	9.827.741
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	4.357.573	–	4.357.573
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	–	251.024	251.024
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	–	139.491	1.975.668	2.115.159
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	–	4.495.645	4.495.645
Gekaufte Swaptions	–	343.188	–	343.188
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>73.667.784</b>	<b>1.380.975.047</b>	<b>7.256.392</b>	<b>1.461.899.223</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(40.945.220)	–	(40.945.220)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(34.573.502)	–	–	(34.573.502)
Verkaufte Optionskontrakte	(64.810)	(365.579.826)	(378.349)	(366.022.985)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(98.465.551)	(28.400)	(98.493.951)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(508.312)	–	(508.312)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(12.213.481)	–	(12.213.481)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(6.121.436)	–	(6.121.436)
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	–	–	(281.430)	(281.430)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	–	(5.714.671)	(5.714.671)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(34.638.312)</b>	<b>(523.833.826)</b>	<b>(6.402.850)</b>	<b>(564.874.988)</b>

\* Optionen und Swaps der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet.

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$
<b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b>			
Differenzkontrakte	(65.093)	65.093	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 wurden aufgrund der vom Portfolio angewandten Bewertungsverfahren für Wertpapiere Differenzkontrakte von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, wie in Anmerkung 1 der Anmerkungen zum Jahresabschluss dargelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

XXXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	13.221.435	–	13.221.435
Aktien	16.089.324	–	–	16.089.324
Immobilienaktiengesellschaften	3.946.436	–	–	3.946.436
Schatzwechsel	–	449.200.010	–	449.200.010
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	54.485.356	–	54.485.356
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	8.521.839	–	–	8.521.839
Gekaufte Optionskontrakte	15.415.785	20.361.008	81.777	35.858.570
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	13.934.583	–	13.934.583
Gekaufte Swaptions	–	68.848	–	68.848
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	1.024.404	–	1.024.404
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	678.244	–	678.244
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	–	319.127	–	319.127
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	1.343.255	–	1.343.255
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	0	–	0
<b>Insgesamt</b>	<b>43.973.384</b>	<b>554.636.270</b>	<b>81.777</b>	<b>598.691.431</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(6.317.151)	–	(6.317.151)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(4.922.598)	–	–	(4.922.598)
Verkaufte Optionskontrakte	(5.613.286)	(36.846.894)	–	(42.460.180)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(3.269.736)	–	(3.269.736)
Verkaufte Swaptionen	–	(20.738)	–	(20.738)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(47.926)	–	(47.926)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(1.000.582)	–	(1.000.582)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(13.154)	–	(13.154)
Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten	–	(332.219)	–	(332.219)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	(939.941)	–	(939.941)
<b>Insgesamt</b>	<b>(10.535.884)</b>	<b>(48.788.341)</b>	<b>–</b>	<b>(59.324.225)</b>

Alle Optionen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	27.005.260	–	–	27.005.260
Immobilienaktiengesellschaften	478.769	–	–	478.769
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.158.080	–	2.158.080
<b>Insgesamt</b>	<b>27.484.029</b>	<b>2.158.080</b>	<b>–</b>	<b>29.642.109</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(546.931)	–	(546.931)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(546.931)</b>	<b>–</b>	<b>(546.931)</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	8.236.976	–	–	8.236.976
Immobilienaktiengesellschaften	141.214	–	–	141.214
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>8.378.190</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>8.378.190</b>

## US Equity Index PutWrite

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Staatsanleihen	–	632.264.076	–	632.264.076
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	16.592.327	–	16.592.327
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>648.856.403</b>	<b>–</b>	<b>648.856.403</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(12.932.325)	–	–	(12.932.325)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.350.871)	–	(1.350.871)
<b>Insgesamt</b>	<b>(12.932.325)</b>	<b>(1.350.871)</b>	<b>–</b>	<b>(14.283.196)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Staatsanleihen	–	392.089.074	–	392.089.074
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.075.693	–	1.075.693
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>393.164.767</b>	<b>–</b>	<b>393.164.767</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(3.669.788)	–	–	(3.669.788)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(155.752)	–	(155.752)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(3.669.788)</b>	<b>(155.752)</b>	<b>–</b>	<b>(3.825.540)</b>

US Large Cap Value<sup>2</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	1.688.625.847	–	–	1.688.625.847
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	973.737	–	973.737
<b>Insgesamt</b>	<b>1.688.625.847</b>	<b>973.737</b>	<b>–</b>	<b>1.689.599.584</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(102.612)	–	(102.612)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(102.612)</b>	<b>–</b>	<b>(102.612)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Large Cap Value<sup>2</sup> (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	2.024.667	–	–	2.024.667
Immobilienaktiengesellschaften	19.361	–	–	19.361
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>2.044.028</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.044.028</b>

## US Long Short Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	8.400.448	–	8.400.448
Aktien	156.744.366	1.265.964	–	158.010.330
Participatory Notes	3.750	–	–	3.750
Immobilienaktiengesellschaften	1.744.930	–	–	1.744.930
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	6.686.844	–	6.686.844
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	470.254	–	–	470.254
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	3.162.728	–	3.162.728
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	664.406	–	664.406
<b>Insgesamt</b>	<b>158.963.300</b>	<b>20.180.390</b>	<b>–</b>	<b>179.143.690</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(74.360)	–	–	(74.360)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(822.791)	–	(822.791)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(1.291.811)	–	(1.291.811)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(700.901)	–	(700.901)
<b>Insgesamt</b>	<b>(74.360)</b>	<b>(2.815.503)</b>	<b>–</b>	<b>(2.889.863)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	5.922.382	–	5.922.382
Aktien	407.697.481	–	–	407.697.481
Participatory Notes	9.330	–	–	9.330
Gekaufte Optionskontrakte	177.671	–	–	177.671
Immobilienaktiengesellschaften	3.613.606	–	–	3.613.606
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	304.263	–	304.263
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	6.956	–	–	6.956
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	1.759.585	–	1.759.585
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	700.627	–	700.627
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>411.505.044</b>	<b>8.686.857</b>	<b>–</b>	<b>420.191.901</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(183.415)	–	–	(183.415)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(4.166.530)	–	(4.166.530)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(769.254)	–	–	(769.254)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(13.725.414)	–	(13.725.414)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(2.294.957)	–	(2.294.957)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>(952.669)</b>	<b>(20.186.901)</b>	<b>–</b>	<b>(21.139.570)</b>

US Multi Cap Opportunities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	439.025.865	–	–	439.025.865
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.736.142	–	2.736.142
<b>Insgesamt</b>	<b>439.025.865</b>	<b>2.736.142</b>	<b>–</b>	<b>441.762.007</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten  
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(587.402)	–	(587.402)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(587.402)</b>	<b>–</b>	<b>(587.402)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	781.762.992	–	–	781.762.992
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	427.087	–	427.087
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>781.762.992</b>	<b>427.087</b>	<b>–</b>	<b>782.190.079</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.041.858)	–	(1.041.858)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(1.041.858)</b>	<b>–</b>	<b>(1.041.858)</b>

## US Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Immobilienaktiengesellschaften	624.531.489	–	–	624.531.489
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	4.089.640	–	4.089.640
<b>Insgesamt</b>	<b>624.531.489</b>	<b>4.089.640</b>	<b>–</b>	<b>628.621.129</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.230.032)	–	(1.230.032)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(1.230.032)</b>	<b>–</b>	<b>(1.230.032)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	16.391.963	–	–	16.391.963
Immobilienaktiengesellschaften	998.183.643	–	–	998.183.643
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	789.444	–	789.444
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>1.014.575.606</b>	<b>789.444</b>	<b>–</b>	<b>1.015.365.050</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.778.536)	–	(3.778.536)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(3.778.536)</b>	<b>–</b>	<b>(3.778.536)</b>

US Small Cap

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	578.779.674	–	–	578.779.674
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	949.457	–	949.457
<b>Insgesamt</b>	<b>578.779.674</b>	<b>949.457</b>	<b>–</b>	<b>579.729.131</b>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(236.699)	–	(236.699)
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(236.699)</b>	<b>–</b>	<b>(236.699)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Small Cap (Fortsetzung)

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	807.479.375	4.531.973	–	812.011.348
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	191.707	–	191.707
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>807.479.375</b>	<b>4.723.680</b>	<b>–</b>	<b>812.203.055</b>

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(653.133)	–	(653.133)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>(653.133)</b>	<b>–</b>	<b>(653.133)</b>

## US Small Cap Intrinsic Value

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3* US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	184.718.734	–	–	184.718.734
Immobilienaktiengesellschaften	2.170.638	–	–	2.170.638
Unternehmensanleihen	–	–	0	0
<b>Insgesamt</b>	<b>186.889.372</b>	<b>–</b>	<b>0</b>	<b>186.889.372</b>

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2021

	Stufe 1 US\$	Stufe 2 US\$	Stufe 3 US\$	Insgesamt US\$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	22.652	–	22.652
Aktien	141.240.874	–	–	141.240.874
Immobilienaktiengesellschaften	1.318.782	–	–	1.318.782
<b>Vermögenswerte insgesamt</b>	<b>142.559.656</b>	<b>22.652</b>	<b>–</b>	<b>142.582.308</b>

\*Eine Unternehmensanleihe der Stufe 3 wurde in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2022 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

**Absolute Return Multi Strategy\***

	<b>Insgesamt US\$</b>
Saldo per 1. Januar 2022	31.388
Verkäufe	(32.202)
Realisierter Nettogewinn	32.201
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(24.621)
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>6.766</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

**Global Flexible Credit Income**

	<b>Insgesamt US\$</b>
Saldo per 1. Januar 2022	–
Käufe	4.900.000
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	347.334
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>5.247.334</b>

**Global High Yield SDG Engagement**

	<b>Insgesamt US\$</b>
Saldo per 1. Januar 2022	–
Käufe	329.588
Verkäufe	(833)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(2.880)
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>325.875</b>

**Global Real Estate Securities**

	<b>Insgesamt US\$</b>
Saldo per 1. Januar 2022	26.761.291
Käufe	6.332.158
Verkäufe	(12.108.694)
Realisierter Nettoverlust	(337.028)
Übertragung aus Stufe 3	(13.907.802)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(948.237)
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>5.791.688</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Multi-Asset Income

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2022	76
Käufe	6
Realisierter Nettoverlust	(104)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	22
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>–</b>

## Short Duration Emerging Market Debt

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2022	–
Übertragung in Stufe 3	500.000
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>500.000</b>

## Short Duration High Yield SDG Engagement

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2022	1.599.050
Verkäufe	(1.595.047)
Realisierter Nettogewinn	7.428
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(11.431)
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>–</b>

## Strategic Income

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2022	1.573.993
Käufe	(145.736)
Verkäufe	(1.411.261)
Realisierter Nettogewinn	1.032
Übertragung in Stufe 3	126.140
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(18.028)
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>126.140</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2022	853.542
Käufe	774.404.693
Verkäufe	(776.937.850)
Realisierter Nettogewinn	10.300.712
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	10.511.668
Übertragung aus Stufe 3	(18.660.166)
Übertragung in Stufe 3	(215.193)
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>257.406</b>

XXXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2022	–
Käufe	1.031.664
Verkäufe	(25.724)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes)	(924.163)
<b>Saldo per 31. Dezember 2022</b>	<b>81.777</b>

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2021 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

Absolute Return Multi Strategy\*

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	616.154
Käufe	35.651
Verkäufe	(288.220)
Realisierter Nettoverlust	(446.196)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	113.999
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>31.388</b>

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Global Real Estate Securities

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	–
Käufe	506.909
Verkäufe	(16.273)
Realisierter Nettoverlust	(455)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(26.731)
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>463.450</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## High Yield Bond

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	12.141.202
Käufe	21.134.484
Verkäufe	(6.690.223)
Realisierter Nettogewinn	426
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	175.402
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>26.761.291</b>

## Multi-Asset Income

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	25
Käufe	98
Realisierter Nettoverlust	(136)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	89
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>76</b>

## Short Duration High Yield SDG Engagement

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	3.861.078
Käufe	237.007
Verkäufe	(2.473.568)
Realisierter Nettogewinn	32.407
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(57.874)
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>1.599.050</b>

## Strategic Income

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	3.600.379
Käufe	(340.964)
Verkäufe	(2.395.792)
Realisierter Nettogewinn	104.679
Übertragung in Stufe 3	711.830
Übertragung aus Stufe 3	(68.132)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(38.007)
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>1.573.993</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Systematic Global Sustainable Value

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	372.572
Käufe	577.700
Verkäufe	(101.781)
Realisierter Nettogewinn	15.405
Übertragung aus Stufe 3	(814.680)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(49.216)
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>–</b>

Uncorrelated Strategies

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	(31.651)
Käufe	1.814.812.087
Verkäufe	(1.811.760.574)
Realisierter Nettogewinn	110.814
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(2.277.134)
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>853.542</b>

US Long Short Equity

	Insgesamt US\$
Saldo per 1. Januar 2021	(1.670)
Realisierter Nettogewinn	49.533
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	(47.863)
<b>Saldo per 31. Dezember 2021</b>	<b>–</b>

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Laufzeitkredite der Stufe 3 sind in erster Linie auf die Preisfindungsmethode zurückzuführen, bei der eine einzelne Broker-Quotierungen (Stufe 3) oder ein einzelner beobachtbare Parameter (Stufe 3) durch den unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verwendet wird. Alle anderen Wertpapiere der Stufe 3 werden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT

## 5G Connectivity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD A NIW	Thesaurierende Klasse AUD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CNY A* NIW	Thesaurierende Klasse CNY A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	17.057.259 AUD	7,98 AUD	2.370.930 CNY	57,01 CNY	43.082.992 €	8,32 €
31. Dezember 2021	38.403.196 AUD	14,75 AUD	5.346.016 CNY	101,38 CNY	114.367.513 €	15,39 €
31. Dezember 2020	24.050.713 AUD	14,24 AUD	–	–	57.903.811 €	14,88 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	54.125.094 €	9,34 €	39.268.790 €	7,73 €	43.589.698 €	9,01 €
31. Dezember 2021	95.941.544 €	15,55 €	76.903.936 €	14,16 €	118.101.577 €	14,87 €
31. Dezember 2020	44.220.145 €	13,81 €	24.110.964 €	13,58 €	16.612.665 €	13,10 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP A NIW	Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.352.834 €	6,97 €	44.772.549 €	9,14 €	10.322.335 £	8,45 £
31. Dezember 2021	3.965.517 €	12,72 €	69.554.657 €	15,33 €	23.031.741 £	15,43 £
31. Dezember 2020	607.688 €	12,15 €	31.520.780 €	13,73 €	11.273.925 £	14,84 £

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse HKD A NIW	Thesaurierende Klasse HKD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	535.353 £	7,81 £	47.629.183 HKD	8,80 HKD	39.375.609 SGD	17,27 SGD
31. Dezember 2021	1.009.328 £	12,20 £	133.998.798 HKD	15,70 HKD	90.358.002 SGD	31,05 SGD
31. Dezember 2020	26.667 £	11,46 £	68.030.088 HKD	15,03 HKD	61.243.815 SGD	29,80 SGD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	421.532.776 \$	9,12 \$	144.216.650 \$	9,79 \$	18.941.211 \$	9,79 \$
31. Dezember 2021	998.982.677 \$	16,17 \$	426.247.636 \$	17,22 \$	53.711.877 \$	17,21 \$
31. Dezember 2020	665.216.837 \$	15,46 \$	244.969.849 \$	16,32 \$	23.717.213 \$	16,31 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	6.231.632 \$	6,26 \$	64.460.647 \$	6,65 \$	11.306.667 \$	9,07 \$
31. Dezember 2021	10.938.003 \$	10,98 \$	124.140.837 \$	11,67 \$	39.945.606 \$	15,89 \$
31. Dezember 2020	–	–	45.096.460 \$	11,03 \$	32.102.331 \$	15,00 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## 5G Connectivity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	23.507.641 \$	8,04 \$	700.508 \$	6,24 \$
31. Dezember 2021	50.689.515 \$	14,37 \$	954.074 \$	10,88 \$
31. Dezember 2020	107.572.681 \$	13,86 \$	–	–

## Absolute Return Multi Strategy\*\*

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	1.788.357 CHF	9,60 CHF	834.532 €	9,31 €	357.019 €	9,72 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z* NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	310.487 €	10,15 €	1.156.688 €	9,87 €	52.547 €	10,31 €

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Absolute Return Multi Strategy\*\* (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP Z*	Thesaurierende Klasse GBP Z*	Ausschüttende Klasse JPY D*	Ausschüttende Klasse JPY D*	Thesaurierende Klasse JPY I*	Thesaurierende Klasse JPY I*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	130.962 £	10,92 £	90.586.446 ¥	983,29 ¥	4.732.899.851 ¥	982,69 ¥

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD Z*	Thesaurierende Klasse USD Z*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	3.209.486 \$	10,52 \$	2.080.102 \$	11,17 \$	124.386 \$	11,42 \$

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Asian Debt – Hard Currency

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD A
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	274.934 \$	7,83 \$	1.309.918 \$	10,99 \$
31. Dezember 2021	–	–	339.937 \$	9,54 \$	2.190.283 \$	12,77 \$
31. Dezember 2020	142.865 SGD	20,00 SGD	1.032.834 \$	10,17 \$	2.786.141 \$	13,01 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	168.834 \$	8,68 \$	344.730 \$	11,47 \$	10.492.727 \$	8,96 \$
31. Dezember 2021	414.971 \$	10,19 \$	546.459 \$	13,26 \$	10.231.270 \$	10,70 \$
31. Dezember 2020	1.535.244 \$	10,49 \$	138.849 \$	13,43 \$	10.817.141 \$	11,24 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD M
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	10.118 \$	10,12 \$	10.229 \$	10,23 \$	490.875 \$	8,86 \$
31. Dezember 2021	–	–	–	–	696.734 \$	10,36 \$
31. Dezember 2020	–	–	–	–	1.739.079 \$	10,62 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z*	Thesaurierende Klasse USD Z*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	10.098 \$	10,10 \$	18.734 \$	8,54 \$	8.490.714 \$	10,01 \$
31. Dezember 2021	–	–	9.868 \$	9,87 \$	–	–
31. Dezember 2020	–	–	–	–	–	–



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CNY I NIW	Thesaurierende Klasse CNY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	133.897 CNY	91,62 CNY	27.220 \$	9,28 \$	2.319.140 \$	9,27 \$
31. Dezember 2021	173.171 CNY	118,49 CNY	578.160 \$	13,05 \$	3.263.395 \$	13,05 \$
31. Dezember 2020	81.330 CNY	118,25 CNY	1.227.199 \$	12,75 \$	1.249.390 \$	12,75 \$

China Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CNY I NIW	Ausschüttende Klasse CNY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CNY Z NIW	Thesaurierende Klasse CNY Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	156.137 CNY	78,36 CNY	209.325 CNY	89,19 CNY	210.297 CNY	114,82 CNY
31. Dezember 2021	177.774 CNY	89,21 CNY	1.406.816 CNY	97,60 CNY	222.548 CNY	121,51 CNY
31. Dezember 2020	2.890.250 CNY	95,44 CNY	1.459.514 CNY	101,25 CNY	937.164 CNY	120,79 CNY

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	19.572 £	9,00 £
31. Dezember 2021	75.956 €	9,49 €	581.939 €	10,39 €	43.285 £	9,69 £
31. Dezember 2020	80.293 €	10,04 €	508.185 €	9,46 €	–	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## China Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Ausschüttende Klasse	Ausschüttende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse
	GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) NIW	SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	USD I (nicht währungsgesichert) NIW	USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	1.003.087 SGD	14,69 SGD	5.761.473 \$	10,22 \$
31. Dezember 2021	–	–	3.571.270 SGD	18,30 SGD	21.420.695 \$	11,85 \$
31. Dezember 2020	14.953.495 £	9,60 £	1.258.824 SGD	18,78 SGD	9.484.209 \$	11,61 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse
	USD M (nicht währungsgesichert)* NIW	USD M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	USD Z NIW	USD Z NIW je Anteil	USD Z (nicht währungsgesichert) NIW	USD Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	47.003.040 \$	9,49 \$	11.882.617 \$	9,78 \$
31. Dezember 2021	–	–	52.475.111 \$	10,13 \$	13.733.211 \$	11,26 \$
31. Dezember 2020	195.013 \$	10,91 \$	56.192.453 \$	10,35 \$	24.338 \$	10,96 \$

## China Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse	Thesaurierende Klasse
	CHF I NIW	CHF I NIW je Anteil	EUR A NIW	EUR A NIW je Anteil	EUR I NIW	EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	355.994 CHF	12,23 CHF	1.489.033 €	21,49 €	1.254.577 €	23,33 €
31. Dezember 2021	468.597 CHF	16,10 CHF	2.593.043 €	28,39 €	1.813.319 €	30,58 €
31. Dezember 2020	504.251 CHF	17,33 CHF	2.864.919 €	30,75 €	2.263.915 €	32,88 €

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	16.058 €	18,02 €
31. Dezember 2021	–	–	–	–	20.820 €	23,36 €
31. Dezember 2020	89.554 €	18,85 €	241.981 €	19,52 €	22.135 €	24,84 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP A NIW	Ausschüttende Klasse GBP A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	13.559 £	10,70 £	–	–	–	–
31. Dezember 2021	226.611 £	13,93 £	276.624 £	28,73 £	–	–
31. Dezember 2020	556.366 £	15,01 £	293.477 £	30,48 £	331.119 £	19,39 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse HKD A* NIW	Thesaurierende Klasse HKD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	2.180.349 SGD	30,18 SGD
31. Dezember 2021	–	–	–	–	3.238.056 SGD	39,04 SGD
31. Dezember 2020	42.862 £	17,86 £	1.448.117 HKD	15,71 HKD	4.172.500 SGD	41,98 SGD

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Ausschüttende	Ausschüttende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse USD A NIW	Klasse USD A NIW je Anteil	Klasse USD A NIW	Klasse USD A NIW je Anteil	Klasse USD I NIW	Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	28.844.956 \$	25,67 \$	786.778 \$	15,80 \$	240.949.106 \$	27,95 \$
31. Dezember 2021	49.687.137 \$	32,88 \$	1.619.142 \$	20,24 \$	363.801.495 \$	35,53 \$
31. Dezember 2020	76.930.563 \$	35,24 \$	2.181.035 \$	21,70 \$	493.105.042 \$	37,80 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Ausschüttende	Ausschüttende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse USD I2 NIW	Klasse USD I2 NIW je Anteil	Klasse USD I4* NIW	Klasse USD I4* NIW je Anteil	Klasse USD M NIW	Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	15.248.435 \$	17,28 \$	–	–	20.188 \$	14,88 \$
31. Dezember 2021	21.510.739 \$	21,91 \$	–	–	43.760.360 \$	19,25 \$
31. Dezember 2020	26.896.747 \$	23,26 \$	296.197 \$	19,43 \$	47.371.641 \$	20,84 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse USD U NIW	Klasse USD U NIW je Anteil	Klasse USD Z NIW	Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	26.266.970 \$	17,93 \$	304.598 \$	18,83 \$
31. Dezember 2021	39.927.816 \$	22,88 \$	383.001 \$	23,68 \$
31. Dezember 2020	53.309.577 \$	24,42 \$	402.911 \$	24,91 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

CLO Income

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	62.426 €	9,67 €	11.405.488 €	10,23 €	12.590.646 €	7,90 €
31. Dezember 2021	–	–	2.024.965 €	11,21 €	14.114.006 €	9,24 €
31. Dezember 2020	–	–	1.209.793 €	10,52 €	6.264.914 €	9,06 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	22.140.124 £	8,17 £	–	–	52.625 £	10,84 £
31. Dezember 2021	30.837.441 £	9,37 £	26.082 £	9,38 £	82.828 £	11,60 £
31. Dezember 2020	14.791.942 £	9,12 £	25.380 £	9,13 £	76.579 £	10,73 £

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK I NIW	Thesaurierende Klasse SEK I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	29.102.703 SEK	104,04 SEK	62.292 \$	9,83 \$	14.305.878 \$	11,19 \$
31. Dezember 2021	34.950.701 SEK	113,40 SEK	–	–	18.681.077 \$	12,02 \$
31. Dezember 2020	43.276.367 SEK	105,94 SEK	–	–	17.846.790 \$	11,18 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende	Ausschüttende	Ausschüttende	Ausschüttende	Ausschüttende	Ausschüttende
	Klasse USD I2 NIW	Klasse USD I2 NIW je Anteil	Klasse USD I4* NIW	Klasse USD I4* NIW je Anteil	Klasse USD I5 NIW	Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	30.076.757 \$	9,09 \$	–	–	37.889.294 \$	8,65 \$
31. Dezember 2021	25.769.475 \$	10,40 \$	–	–	40.735.952 \$	9,89 \$
31. Dezember 2020	10.111.392 \$	10,11 \$	27.012.939 \$	10,37 \$	25.341.231 \$	9,62 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse USD Z NIW	Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	491.530 \$	11,53 \$
31. Dezember 2021	524.027 \$	12,30 \$
31. Dezember 2020	407.835 \$	11,35 \$

Commodities<sup>1</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Klasse GBP I5* NIW	Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Klasse USD A* NIW	Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.401 £	10,43 £	16.248.150 £	9,42 £	2.916.591 \$	9,71 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse USD I* NIW	Klasse USD I* NIW je Anteil	Klasse USD I5* NIW	Klasse USD I5* NIW je Anteil	Klasse USD M* NIW	Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	247.698 \$	11,20 \$	59.937.610 \$	9,78 \$	432.835 \$	8,91 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Commodities<sup>1</sup> (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.656.009 \$	11,32 \$

Corporate Hybrid Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF P NIW	Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF P NIW	Ausschüttende Klasse CHF P NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.816.413 AUD	7,88 AUD	22.917.824 CHF	9,64 CHF	1.547.416 CHF	8,79 CHF
31. Dezember 2021	9.317.570 AUD	9,58 AUD	54.604.181 CHF	11,27 CHF	2.871.450 CHF	10,61 CHF
31. Dezember 2020	10.562.365 AUD	10,00 AUD	35.615.361 CHF	11,23 CHF	3.398.551 CHF	10,87 CHF

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	38.403.169 €	7,91 €	124.371.360 €	10,36 €	655.035.193 €	11,06 €
31. Dezember 2021	49.140.644 €	9,67 €	181.457.452 €	12,14 €	668.648.608 €	12,88 €
31. Dezember 2020	25.060.595 €	10,07 €	119.052.117 €	12,15 €	373.859.916 €	12,81 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	92.907.803 €	8,98 €	191.477.785 €	10,20 €	177.916.143 €	8,19 €
31. Dezember 2021	102.802.041 €	10,80 €	297.187.874 €	11,86 €	177.907.878 €	9,85 €
31. Dezember 2020	169.145.788 €	11,04 €	320.540.521 €	11,79 €	24.646 €	10,01 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	7.208.715 €	10,30 €	184.534.266 €	11,30 €	11.578.693 €	10,88 €
31. Dezember 2021	9.587.464 €	11,97 €	105.834.591 €	13,12 €	12.260.094 €	12,82 €
31. Dezember 2020	983.596 €	11,89 €	57.014.024 €	13,01 €	13.262.489 €	12,91 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR P NIW	Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR P NIW	Ausschüttende Klasse EUR P NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.553.082 €	7,61 €	37.115.535 €	9,84 €	4.537.698 €	9,02 €
31. Dezember 2021	5.282.983 €	9,33 €	172.678.924 €	11,46 €	9.906.904 €	10,84 €
31. Dezember 2020	4.729.002 €	9,72 €	89.119.718 €	11,39 €	8.459.670 €	11,09 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	5.461.763 £	10,54 £	10.032.613 £	10,38 £	406.601 £	9,09 £
31. Dezember 2021	7.515.008 £	12,08 £	65.235.151 £	11,88 £	2.229.096 £	10,76 £
31. Dezember 2020	3.925.010 £	11,94 £	59.705.060 £	11,73 £	2.213.285 £	10,93 £



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP P NIW	Ausschüttende Klasse GBP P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	6.021.069 £	9,48 £	7.470.246 £	8,78 £	–	–
31. Dezember 2021	7.982.111 £	10,86 £	5.490.392 £	10,40 £	–	–
31. Dezember 2020	2.276.020 £	10,73 £	4.230.115 £	10,56 £	3.506.390 HKD	10,02 HKD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.412.307 SGD	16,07 SGD	55.263.711 \$	8,26 \$	49.003.214 \$	11,18 \$
31. Dezember 2021	2.442.580 SGD	19,43 SGD	92.010.151 \$	9,96 \$	70.561.322 \$	12,82 \$
31. Dezember 2020	3.198.132 SGD	20,23 SGD	71.163.061 \$	10,39 \$	65.345.286 \$	12,72 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A* NIW	Ausschüttende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	66.746 \$	8,44 \$	5.909.890 \$	9,66 \$	54.193.798 \$	12,35 \$
31. Dezember 2021	78.523 \$	9,93 \$	9.625.219 \$	11,19 \$	222.206.104 \$	14,08 \$
31. Dezember 2020	–	–	12.294.801 \$	11,22 \$	194.815.607 \$	13,89 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.406.325 \$	8,45 \$	6.709.367 \$	11,52 \$	5.086.148 \$	9,68 \$
31. Dezember 2021	1.303.331 \$	9,94 \$	85.047.842 \$	13,12 \$	1.422.475 \$	11,39 \$
31. Dezember 2020	–	–	72.424.407 \$	12,93 \$	1.285.824 \$	11,55 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD P
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.149.257 \$	9,86 \$	2.213.713 \$	8,23 \$	15.462.358 \$	11,00 \$
31. Dezember 2021	12.021.879 \$	11,38 \$	2.946.315 \$	9,87 \$	67.895.964 \$	12,54 \$
31. Dezember 2020	19.198.032 \$	11,37 \$	3.166.034 \$	10,20 \$	44.062.765 \$	12,36 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse USD Z
	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	399.396 \$	11,84 \$
31. Dezember 2021	224.418 \$	13,42 \$
31. Dezember 2020	4.176.275 \$	13,16 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Diversified Currency\*\*

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	17.963 €	10,04 €	39.695 €	8,79 €	121.320 \$	10,58 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–
31. Dezember 2021	–	–
31. Dezember 2020	1.119.707 \$	11,19 \$

\*\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

Emerging Market Debt - Hard Currency

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD I NIW	Ausschüttende Klasse AUD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.134.881 AUD	6,88 AUD	21.672.088 AUD	7,81 AUD	47.479.252 CAD	11,04 CAD
31. Dezember 2021	3.086.824 AUD	9,17 AUD	31.429.849 AUD	10,32 AUD	–	–
31. Dezember 2020	4.622.659 AUD	10,11 AUD	28.579.950 AUD	11,16 AUD	–	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF P NIW	Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	161.496.077 CHF	7,73 CHF	21.658.399 CHF	7,79 CHF	7.363.041 €	6,20 €
31. Dezember 2021	50.748.457 CHF	9,80 CHF	35.834.088 CHF	9,89 CHF	10.607.100 €	8,36 €
31. Dezember 2020	26.756.674 CHF	10,25 CHF	29.906.715 CHF	10,35 CHF	11.980.897 €	9,28 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	32.580.202 €	9,53 €	118.505.956 €	10,31 €	17.296.623 €	8,82 €
31. Dezember 2021	30.854.130 €	12,16 €	346.351.970 €	13,06 €	1.141.580 €	10,22 €
31. Dezember 2020	32.848.913 €	12,79 €	336.027.173 €	13,64 €	1.167.833 €	9,83 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	178.942.116 €	6,49 €	61.386.430 €	7,87 €	32.976.153 €	6,96 €
31. Dezember 2021	267.762.991 €	8,68 €	100.699.618 €	9,96 €	40.279.528 €	9,32 €
31. Dezember 2020	256.501.278 €	9,45 €	144.677.580 €	10,39 €	48.436.210 €	10,14 €

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	101.186.993 €	8,83 €	29.023.972 €	8,76 €	–	–
31. Dezember 2021	112.230.449 €	11,16 €	39.028.171 €	10,12 €	2.658.043 €	9,44 €
31. Dezember 2020	77.420.551 €	11,64 €	83.523.217 €	9,72 €	6.796.310 €	10,27 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	106.621.915 €	9,97 €	68.627.475 €	10,00 €	625.349 €	8,95 €
31. Dezember 2021	172.221.503 €	12,60 €	–	–	880.261 €	11,51 €
31. Dezember 2020	169.073.590 €	13,13 €	–	–	1.397.235 €	12,21 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR P NIW	Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	136.677 €	6,16 €	9.665.588 €	7,98 €	298.344 €	8,27 €
31. Dezember 2021	234.678 €	8,44 €	42.731.452 €	10,11 €	375.373 €	10,41 €
31. Dezember 2020	593.333 €	9,41 €	13.190.690 €	10,56 €	339.152 €	10,80 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Ausschüttende	Ausschüttende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse GBP I NIW	Klasse GBP I NIW je Anteil	Klasse GBP I NIW	Klasse GBP I NIW je Anteil	Klasse GBP I2 NIW	Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	16.360.366 £	9,55 £	1.864.069 £	6,91 £	31.637.924 £	8,39 £
31. Dezember 2021	24.108.278 £	11,92 £	7.886.830 £	9,11 £	37.494.529 £	10,45 £
31. Dezember 2020	9.061.809 £	12,38 £	4.772.238 £	9,85 £	35.586.494 £	10,84 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende	Ausschüttende	Thesaurierende	Thesaurierende	Ausschüttende	Ausschüttende
	Klasse GBP I2 NIW	Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Klasse GBP P NIW	Klasse GBP P NIW je Anteil	Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	11.800.925 £	7,18 £	7.543.092 £	8,56 £	1.259.413 HKD	7,38 HKD
31. Dezember 2021	17.959.384 £	9,47 £	6.433.590 £	10,68 £	2.284.462 HKD	9,73 HKD
31. Dezember 2020	86.136.176 £	10,24 £	5.938.055 £	11,09 £	3.737.719 HKD	10,70 HKD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse JPY I NIW	Klasse JPY I NIW je Anteil	Klasse SEK A NIW	Klasse SEK A NIW je Anteil	Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)* NIW	Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.632.621.347 ¥	816,31 ¥	1.276.699.611 SEK	91,78 SEK	–	–
31. Dezember 2021	2.067.191.771 ¥	1.033,60 ¥	1.014.308.991 SEK	116,99 SEK	315.419 SEK	105,50 SEK
31. Dezember 2020	2.149.865.574 ¥	1.074,93 ¥	847.947.649 SEK	122,77 SEK	296.055 SEK	99,02 SEK

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK I2* NIW	Thesaurierende Klasse SEK I2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	135.368.249 SEK	77,53 SEK	16.860.018 SGD	13,92 SGD	144.691.919 \$	6,89 \$
31. Dezember 2021	261.889.492 SEK	98,00 SEK	23.217.536 SGD	18,39 SGD	271.875.924 \$	9,06 \$
31. Dezember 2020	–	–	25.878.145 SGD	20,21 SGD	183.070.206 \$	9,95 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	112.403.688 \$	11,26 \$	42.552 \$	7,74 \$	10.176.824 \$	8,45 \$
31. Dezember 2021	167.936.528 \$	13,99 \$	24.437 \$	10,06 \$	15.072.281 \$	10,60 \$
31. Dezember 2020	205.783.308 \$	14,58 \$	10.731 \$	10,73 \$	35.072.677 \$	11,16 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	583.066.950 \$	12,04 \$	80.694.053 \$	7,70 \$	33.738.168 \$	10,45 \$
31. Dezember 2021	846.829.107 \$	14,86 \$	151.677.969 \$	10,02 \$	182.237.940 \$	12,87 \$
31. Dezember 2020	979.308.959 \$	15,37 \$	141.097.094 \$	10,79 \$	371.126.568 \$	13,30 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I4* NIW	Ausschüttende Klasse USD I4* NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	13.108.552 \$	7,47 \$	81.371.873 \$	7,60 \$	–	–
31. Dezember 2021	28.105.309 \$	9,71 \$	103.575.521 \$	9,89 \$	–	–
31. Dezember 2020	67.483.173 \$	10,46 \$	131.068.021 \$	10,65 \$	5.014.382 \$	10,03 \$

	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	16.134.339 \$	8,52 \$	3.112.446 \$	6,39 \$	17.590.354 \$	8,95 \$
31. Dezember 2021	23.509.954 \$	10,67 \$	4.183.182 \$	8,52 \$	30.611.343 \$	11,03 \$
31. Dezember 2020	37.254.909 \$	11,21 \$	7.579.872 \$	9,39 \$	51.846.150 \$	11,41 \$

	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>				
31. Dezember 2022	98.360.925 \$	8,15 \$	97.737 \$	10,02 \$
31. Dezember 2021	25.072.481 \$	10,03 \$	10.072.039 \$	12,27 \$
31. Dezember 2020	–	–	3.131.677 \$	12,61 \$



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.579.112 AUD	3,54 AUD	279.747 AUD	7,62 AUD	67.549 AUD	3,53 AUD
31. Dezember 2021	13.367.215 AUD	4,65 AUD	547.824 AUD	9,06 AUD	335.367 AUD	4,64 AUD
31. Dezember 2020	36.303.151 AUD	5,83 AUD	1.998.333 AUD	10,28 AUD	7.096.374 AUD	5,84 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil
31. Dezember 2022	7.870 AUD	7,61 AUD	399.839 AUD	3,54 AUD	43.406 AUD	7,61 AUD
31. Dezember 2021	137.972 AUD	9,05 AUD	1.991.255 AUD	4,66 AUD	67.654 AUD	9,05 AUD
31. Dezember 2020	778.438 AUD	10,28 AUD	11.462.023 AUD	5,84 AUD	803.632 AUD	10,27 AUD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	27.559.985 AUD	3,81 AUD	2.188.886 AUD	8,21 AUD	2.710.862 €	6,52 €
31. Dezember 2021	35.067.739 AUD	4,97 AUD	2.587.589 AUD	9,66 AUD	25.996.331 €	7,75 €
31. Dezember 2020	44.340.914 AUD	6,17 AUD	2.815.360 AUD	10,85 AUD	32.036.136 €	8,72 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR 12 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR 12 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	12.677.170 €	6,99 €	153.261.974 €	9,22 €	13.077.476 €	10,86 €
31. Dezember 2021	30.265.508 €	8,25 €	192.874.499 €	9,93 €	35.836.407 €	11,69 €
31. Dezember 2020	33.554.119 €	9,21 €	198.964.589 €	10,19 €	46.174.682 €	11,98 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR 13 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse EUR 13 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR 14 (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse EUR 14 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR 15 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR 15 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	18.536.988 €	7,20 €	–	–
31. Dezember 2021	10.292.044 €	8,91 €	20.906.428 €	8,12 €	–	–
31. Dezember 2020	12.192.408 €	9,52 €	22.339.437 €	8,68 €	59.736.117 €	10,35 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	79.014.824 €	9,22 €
31. Dezember 2021	–	–	238.538 €	7,13 €	97.240.658 €	9,89 €
31. Dezember 2020	181.790 €	11,07 €	393.505 €	7,94 €	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	71.487 £	7,65 £	55.720.554 £	9,67 £	34.761.741 £	7,20 £
31. Dezember 2021	79.233 £	8,89 £	91.993.396 £	9,83 £	81.473.761 £	7,69 £
31. Dezember 2020	87.893 £	9,86 £	254.174.766 £	10,72 £	51.909.562 £	8,76 £

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	51.131.054 £	9,22 £	8.262.545 SEK	80,46 SEK
31. Dezember 2021	–	–	115.816.857 £	9,36 £	10.695.289 SEK	95,54 SEK
31. Dezember 2020	68.949.728 £	11,73 £	–	–	13.447.625 SEK	107,28 SEK

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	431.283 SGD	10,66 SGD	2.763.181 \$	4,73 \$	13.383.059 \$	7,78 \$
31. Dezember 2021	649.455 SGD	13,26 SGD	6.244.240 \$	5,84 \$	18.460.479 \$	8,99 \$
31. Dezember 2020	1.694.465 SGD	15,77 SGD	4.378.190 \$	6,94 \$	25.257.659 \$	10,01 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	11.674.878 \$	3,97 \$	507.723 \$	7,99 \$	–	–
31. Dezember 2021	36.742.638 \$	5,14 \$	2.532.846 \$	9,36 \$	–	–
31. Dezember 2020	94.090.812 \$	6,41 \$	4.973.729 \$	10,55 \$	156.484 \$	10,45 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	523.171 \$	3,97 \$	22.894 \$	7,99 \$	3.285.216 \$	3,97 \$
31. Dezember 2021	1.870.919 \$	5,14 \$	96.102 \$	9,36 \$	8.118.705 \$	5,14 \$
31. Dezember 2020	7.092.907 \$	6,41 \$	635.543 \$	10,56 \$	24.137.327 \$	6,41 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	313.230 \$	7,99 \$	39.776.506 \$	7,52 \$	373.741.103 \$	8,36 \$
31. Dezember 2021	785.843 \$	9,36 \$	70.740.746 \$	9,23 \$	471.679.737 \$	9,60 \$
31. Dezember 2020	2.802.590 \$	10,55 \$	–	–	718.694.596 \$	10,59 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	537.178 \$	6,94 \$	54.407.790 \$	8,12 \$	18 \$	9,08 \$
31. Dezember 2021	16.255.837 \$	8,34 \$	87.839.639 \$	9,30 \$	21 \$	10,74 \$
31. Dezember 2020	22.464.438 \$	9,59 \$	122.221.709 \$	10,25 \$	353.193.174 \$	11,93 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M* NIW	Ausschüttende Klasse USD M* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	48.894.990 \$	4,35 \$	4.066.572 \$	8,61 \$
31. Dezember 2021	–	–	57.094.005 \$	5,58 \$	3.643.090 \$	9,99 \$
31. Dezember 2020	19.074 \$	9,54 \$	74.449.418 \$	6,88 \$	4.206.519 \$	11,15 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	141.579.673 \$	8,27 \$	154.229.779 \$	8,03 \$	123.706.182 ZAR	36,58 ZAR
31. Dezember 2021	158.320.032 \$	9,45 \$	185.351.561 \$	9,18 \$	372.074.859 ZAR	47,97 ZAR
31. Dezember 2020	163.439.015 \$	10,39 \$	–	–	786.482.697 ZAR	60,32 ZAR

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	6.630.951 ZAR	107,97 ZAR	2.919.213 ZAR	36,57 ZAR	99.096 ZAR	107,97 ZAR
31. Dezember 2021	20.592.012 ZAR	122,85 ZAR	13.001.826 ZAR	47,95 ZAR	2.369.046 ZAR	122,83 ZAR
31. Dezember 2020	51.556.231 ZAR	133,54 ZAR	69.772.615 ZAR	60,30 ZAR	6.024.122 ZAR	133,52 ZAR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	20.692.248 ZAR	36,58 ZAR	790.752 ZAR	107,98 ZAR	549.054.261 ZAR	39,47 ZAR
31. Dezember 2021	87.281.421 ZAR	47,96 ZAR	3.924.596 ZAR	122,85 ZAR	640.987.979 ZAR	51,24 ZAR
31. Dezember 2020	308.873.244 ZAR	60,32 ZAR	22.760.478 ZAR	133,56 ZAR	984.076.012 ZAR	63,79 ZAR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2022	40.857.889 ZAR	116,49 ZAR
31. Dezember 2021	35.519.500 ZAR	131,23 ZAR
31. Dezember 2020	50.421.010 ZAR	141,21 ZAR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW	Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.275.300 AUD	7,49 AUD	10.503.424 €	9,66 €	206.919.548 €	9,92 €
31. Dezember 2021	7.443.128 AUD	8,87 AUD	8.159.335 €	11,09 €	289.180.614 €	11,31 €
31. Dezember 2020	12.337.115 AUD	9,53 AUD	22.523.225 €	11,49 €	281.551.972 €	11,63 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	24.719.131 €	6,93 €	19.433.459 €	10,19 €	9.667.380 €	6,74 €
31. Dezember 2021	39.783.115 €	8,29 €	39.777.757 €	11,60 €	19.021.300 €	8,07 €
31. Dezember 2020	52.449.335 €	8,87 €	290.082.908 €	11,91 €	37.285.901 €	8,64 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	22.443 €	7,48 €	579.587 €	9,81 €	21.116.810 €	10,76 €
31. Dezember 2021	26.733 €	8,91 €	542.937 €	10,69 €	28.115.162 €	12,22 €
31. Dezember 2020	41.809.768 €	9,54 €	802.328 €	10,51 €	28.095.258 €	12,53 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Ausschüttende	Ausschüttende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse EUR M NIW	Klasse EUR M NIW je Anteil	Klasse EUR M NIW	Klasse EUR M NIW je Anteil	Klasse EUR Z NIW	Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	497.438 €	9,32 €	241.149 €	6,05 €	101.072 €	10,65 €
31. Dezember 2021	692.926 €	10,79 €	526.771 €	7,54 €	114.450 €	12,06 €
31. Dezember 2020	1.033.414 €	11,27 €	838.160 €	8,35 €	149.520 €	12,32 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Ausschüttende	Ausschüttende
	Klasse GBP I NIW	Klasse GBP I NIW je Anteil	Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Klasse GBP I NIW	Klasse GBP I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	350.186 £	10,65 £	5.345 £	9,93 £	11.265.349 £	7,75 £
31. Dezember 2021	560.031 £	11,71 £	81.741.756 £	10,26 £	19.053.387 £	8,95 £
31. Dezember 2020	827.671 £	12,40 £	129.996.866 £	10,79 £	17.562.005 £	9,86 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende	Ausschüttende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende	Thesaurierende
	Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Klasse GBP P NIW	Klasse GBP P NIW je Anteil	Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW	Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	560.698 £	8,39 £	6.745.122 £	9,33 £	962.313 £	9,85 £
31. Dezember 2021	615.334 £	9,09 £	68.691.789 £	10,26 £	1.227.759 £	10,18 £
31. Dezember 2020	744.375 £	9,96 £	28.164.666 £	10,85 £	1.154.865 £	10,71 £



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse NOK U NIW	Thesaurierende Klasse NOK U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	194.796 £	11,54 £	228.017 NOK	99,75 NOK	27.339.928 SEK	103,59 SEK
31. Dezember 2021	212.772 £	12,60 £	252.567 NOK	110,49 NOK	29.175.467 SEK	114,14 SEK
31. Dezember 2020	277.214 £	13,24 £	9.249.526 NOK	116,34 NOK	74.265.173 SEK	116,56 SEK

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.038.162 SGD	12,31 SGD	342.321 \$	6,26 \$	10.292.897 \$	10,49 \$
31. Dezember 2021	5.096.662 SGD	15,39 SGD	479.450 \$	7,79 \$	13.236.655 \$	12,29 \$
31. Dezember 2020	1.013.440 SGD	17,33 SGD	387.419 \$	8,85 \$	13.780.922 \$	13,14 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.059.311 \$	8,23 \$	27.687.499 \$	9,85 \$	417.314 \$	7,69 \$
31. Dezember 2021	1.352.420 \$	9,74 \$	95.215.396 \$	11,47 \$	1.720.755 \$	9,38 \$
31. Dezember 2020	2.630.014 \$	10,52 \$	174.767.462 \$	12,18 \$	1.134.281 \$	10,37 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2*	Thesaurierende Klasse USD I2*	Ausschüttende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD I3
Geschäftsjahr zum	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	38.999.171 \$	7,05 \$	41.113.489 \$	8,98 \$
31. Dezember 2021	10.439 \$	12,18 \$	56.056.559 \$	8,61 \$	47.739.922 \$	10,43 \$
31. Dezember 2020	11.065 \$	12,91 \$	55.396.416 \$	9,52 \$	44.413.446 \$	11,05 \$

	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse USD Z
Geschäftsjahr zum	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	737.778 \$	8,29 \$	486.413 \$	5,94 \$	110.712 \$	11,70 \$
31. Dezember 2021	1.152.835 \$	9,79 \$	555.953 \$	7,56 \$	143.969 \$	13,52 \$
31. Dezember 2020	4.463.119 \$	10,55 \$	1.855.489 \$	8,63 \$	165.320 \$	14,26 \$

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

	Thesaurierende Klasse AUD I2*	Thesaurierende Klasse AUD I2*	Thesaurierende Klasse NOK I	Thesaurierende Klasse NOK I	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I
Geschäftsjahr zum	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	21.961.420 AUD	8,67 AUD	297.517.124 NOK	103,11 NOK	38.055 \$	10,34 \$
31. Dezember 2021	25.150.120 AUD	9,93 AUD	151.079.339 NOK	116,42 NOK	3.064.011 \$	12,07 \$
31. Dezember 2020	–	–	6.494.974 NOK	121,36 NOK	3.228.650 \$	12,70 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.047.197 \$	8,61 \$	–	–	5.087.444 \$	10,33 \$
31. Dezember 2021	4.719.304 \$	10,04 \$	–	–	4.184.553 \$	11,99 \$
31. Dezember 2020	–	–	31.411 \$	12,81 \$	4.695.328 \$	12,54 \$

Emerging Markets Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil
31. Dezember 2022	389.876 AUD	9,13 AUD	11.442 AUD	9,13 AUD	125.310 AUD	9,12 AUD
31. Dezember 2021	973.288 AUD	12,57 AUD	86.974 AUD	12,57 AUD	149.325 AUD	12,56 AUD
31. Dezember 2020	1.841.419 AUD	13,57 AUD	41.529 AUD	13,58 AUD	556.360 AUD	13,57 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD I2* NIW	Ausschüttende Klasse CAD I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.741.416 AUD	9,69 AUD	65.215 CAD	7,87 CAD	11.406.458 CAD	7,64 CAD
31. Dezember 2021	2.482.029 AUD	13,22 AUD	99.440 CAD	9,67 CAD	15.162.299 CAD	10,16 CAD
31. Dezember 2020	4.286.412 AUD	14,13 AUD	64.160.602 CAD	10,30 CAD	–	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.362.334 €	8,60 €	429.393 €	9,87 €	163.271 €	7,33 €
31. Dezember 2021	4.453.674 €	11,68 €	638.237 €	13,67 €	219.436 €	9,85 €
31. Dezember 2020	3.426.235 €	12,37 €	1.077.506 €	14,78 €	183.919 €	10,33 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	381.404 £	9,77 £	80.198 £	11,72 £	–	–
31. Dezember 2021	507.319 £	13,06 £	276.830 £	15,52 £	2.269.318.913 ¥	1.932,31 ¥
31. Dezember 2020	533.572 £	13,76 £	288.831 £	16,19 £	5.440.453.438 ¥	1.816,51 ¥

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.825.592 \$	9,44 \$	1.423.437 \$	9,96 \$	–	–
31. Dezember 2021	5.958.601 \$	12,53 \$	4.387.042 \$	13,34 \$	–	–
31. Dezember 2020	6.089.999 \$	13,27 \$	6.658.005 \$	14,27 \$	318.615 \$	10,91 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	119.565 \$	9,95 \$	265.455 \$	9,94 \$	155.175.902 \$	10,66 \$
31. Dezember 2021	441.938 \$	13,33 \$	259.510 \$	13,33 \$	215.496.124 \$	14,00 \$
31. Dezember 2020	512.151 \$	14,27 \$	3.288.833 \$	14,27 \$	238.131.751 \$	14,68 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	398.316 \$	10,60 \$	6.120.100 \$	10,57 \$	11.172.939 \$	10,94 \$
31. Dezember 2021	87.899.018 \$	14,21 \$	5.000.441 \$	14,04 \$	24.331.753 \$	14,23 \$
31. Dezember 2020	93.038.272 \$	15,20 \$	7.438.285 \$	14,87 \$	13.133.116 \$	14,77 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil
31. Dezember 2022	6.247.098 ZAR	121,51 ZAR	1.133.518 ZAR	121,50 ZAR	3.953.205 ZAR	121,51 ZAR
31. Dezember 2021	14.496.527 ZAR	159,43 ZAR	3.248.033 ZAR	159,42 ZAR	7.038.741 ZAR	159,43 ZAR
31. Dezember 2020	26.399.096 ZAR	164,45 ZAR	6.272.736 ZAR	164,43 ZAR	8.794.806 ZAR	164,44 ZAR

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2022	24.141.495 ZAR	129,33 ZAR
31. Dezember 2021	27.707.879 ZAR	168,00 ZAR
31. Dezember 2020	40.775.053 ZAR	171,56 ZAR

## Emerging Markets Select Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.008.452 €	8,70 €	1.269.919.529 ¥	1.112,95 ¥	81.907.316 \$	8,84 \$
31. Dezember 2021	3.415.822 €	10,88 €	1.481.186.443 ¥	1.294,74 ¥	108.356.432 \$	11,79 \$
31. Dezember 2020	6.332.987 €	10,55 €	1.566.429.931 ¥	1.210,66 ¥	112.597.718 \$	12,29 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	68.263 \$	8,53 \$
31. Dezember 2021	33.280 \$	11,55 \$	180.706 \$	11,33 \$
31. Dezember 2020	34.860 \$	12,10 \$	22.690.705 \$	11,77 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.262.829 €	10,52 €	13.827.199 €	10,04 €	18.661.626 €	10,55 €
31. Dezember 2021	4.281.372 €	11,04 €	14.785.620 €	10,73 €	21.860.412 €	11,04 €
31. Dezember 2020	1.428.954 €	10,69 €	14.505.424 €	10,53 €	17.603.374 €	10,67 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	14.615.873 \$	10,86 \$
31. Dezember 2021	14.601.349 \$	11,11 \$
31. Dezember 2020	13.968.385 \$	10,62 \$

Euro Opportunistic Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	78.692 €	9,96 €	9.215.906 €	9,41 €
31. Dezember 2021	35.402 €	11,80 €	11.176.195 €	11,42 €
31. Dezember 2020	35.080 €	11,69 €	11.227.544 €	11,47 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## European High Yield Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR 15*	Thesaurierende Klasse EUR 15*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	875.869 €	12,34 €	–	–
31. Dezember 2021	–	–	804.681 €	13,64 €	–	–
31. Dezember 2020	200.153 €	12,76 €	396.191 €	13,13 €	13.000 €	12,81 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M*	Ausschüttende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse EUR X
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	524.711 €	11,31 €	–	–	5.239.330 €	10,82 €
31. Dezember 2021	468.144 €	12,65 €	–	–	5.714.467 €	11,91 €
31. Dezember 2020	405.210 €	12,33 €	359.549 €	10,04 €	4.540.841 €	11,43 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD A*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	343.199 \$	8,63 \$	–	–
31. Dezember 2021	69.111 SGD	19,86 SGD	1.595.734 \$	9,97 \$	–	–
31. Dezember 2020	1.807.694 SGD	20,24 SGD	685.584 \$	10,17 \$	97.986 \$	11,85 \$



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2022	14.858.536 \$	14,23 \$	–	–	2.659.377 \$	11,95 \$
31. Dezember 2021	16.063.101 \$	15,39 \$	–	–	8.129.396 \$	12,87 \$
31. Dezember 2020	5.534.878 \$	14,70 \$	165.257 \$	11,02 \$	17.339.022 \$	12,25 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	9.687.331 \$	11,25 \$
31. Dezember 2021	10.412.554 \$	12,09 \$
31. Dezember 2020	7.736.042 \$	11,48 \$

European Sustainable Equity<sup>2</sup>

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR A* NIW	Ausschüttende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	20.816 €	7,93 €	29.063 €	9,11 €	3.727.608 €	9,09 €
31. Dezember 2021	–	–	36.335 €	12,14 €	43.048.066 €	12,15 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity<sup>2</sup> (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	126.435.303 €	7,79 €	1.690.128 €	7,96 €	21.161 €	8,83 €
31. Dezember 2021	48.257.250 €	10,37 €	2.114.337 €	10,57 €	28.683 €	11,97 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Z* NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	28.841.630 €	9,12 €	8.028 \$	8,03 \$	16.077.887 \$	8,15 \$
31. Dezember 2021	321.015 €	12,09 €	11.498 \$	11,50 \$	22.830.455 \$	11,58 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	7.914 \$	7,91 \$
31. Dezember 2021	11.426 \$	11,43 \$

Event Driven<sup>1</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P* NIW	Thesaurierende Klasse GBP P* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	23.956.881 £	10,11 £	26.138 £	10,11 £	26.104 £	10,10 £

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Event Driven<sup>1</sup> (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	10.126.565 \$	10,12 \$	2.455.025 \$	10,13 \$

Global Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	29.300 AUD	7,44 AUD	–	–	414.949 \$	8,57 \$
31. Dezember 2021	36.285 AUD	9,22 AUD	–	–	646.469 \$	10,29 \$
31. Dezember 2020	–	–	913.244 \$	12,19 \$	1.471.918 \$	10,97 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* NIW	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	30.527 \$	10,18 \$	1.427.481 \$	9,63 \$	255.883 \$	9,00 \$
31. Dezember 2021	–	–	1.692.881 \$	11,42 \$	767.170 \$	10,76 \$
31. Dezember 2020	–	–	1.757.110 \$	12,00 \$	1.458.608 \$	11,43 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	23.014 \$	7,67 \$	132.650.317 \$	10,10 \$	338.271 ZAR	75,50 ZAR
31. Dezember 2021	28.145 \$	9,38 \$	177.197.847 \$	11,94 \$	416.008 ZAR	92,85 ZAR
31. Dezember 2020	–	–	244.549.518 \$	12,50 \$	–	–

## Global Diversified Income FMP – 2024

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.182.222 €	9,67 €	223.454 €	8,94 €	882.969 €	8,83 €
31. Dezember 2021	1.262.238 €	10,33 €	247.602 €	9,90 €	978.540 €	9,79 €
31. Dezember 2020	2.848.113 €	10,46 €	261.930 €	10,48 €	1.034.112 €	10,34 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse HKD A	Ausschüttende Klasse HKD A	Ausschüttende Klasse SGD A	Ausschüttende Klasse SGD A
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.968.485 £	9,16 £	6.811.671 HKD	9,08 HKD	4.834.873 SGD	18,40 SGD
31. Dezember 2021	2.146.117 £	9,99 £	7.426.965 HKD	9,90 HKD	5.454.504 SGD	20,00 SGD
31. Dezember 2020	2.910.009 £	10,51 £	7.784.792 HKD	10,38 HKD	5.725.831 SGD	21,00 SGD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	29.538.472 \$	10,01 \$	42.245.620 \$	9,23 \$	2.564.036 \$	10,11 \$
31. Dezember 2021	35.468.827 \$	10,47 \$	50.998.594 \$	10,00 \$	4.002.526 \$	10,53 \$
31. Dezember 2020	41.650.016 \$	10,51 \$	66.360.371 \$	10,51 \$	6.095.383 \$	10,53 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD X NIW	Ausschüttende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.069.152 \$	9,23 \$	21.260.082 \$	10,10 \$	53.399.383 \$	9,24 \$
31. Dezember 2021	2.441.459 \$	10,01 \$	22.155.921 \$	10,53 \$	107.962.161 \$	10,01 \$
31. Dezember 2020	6.252.478 \$	10,53 \$	22.155.888 \$	10,53 \$	113.502.504 \$	10,53 \$

Global Equity Index PutWrite\*\*

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I5* NIW	Ausschüttende Klasse CHF I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	2.160.336 CHF	10,38 CHF	2.034.922 CHF	9,32 CHF	176.224 €	10,12 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Equity Index PutWrite\*\* (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	-	-	-	-	-	-
31. Dezember 2021	-	-	-	-	-	-
31. Dezember 2020	5.084.335 €	10,53 €	398.044 €	9,86 €	1.266.613 €	10,19 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Z* NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	-	-	-	-	-	-
31. Dezember 2021	-	-	-	-	-	-
31. Dezember 2020	354.622 €	10,60 €	73.809 £	10,63 £	88.794 \$	11,13 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I5 (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse USD I5 (Monatlich)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	-	-	-	-	-	-
31. Dezember 2021	-	-	-	-	-	-
31. Dezember 2020	346.806 \$	11,49 \$	931.297 \$	10,01 \$	5.859.514 \$	11,49 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Equity Index PutWrite\*\* (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I5*	Ausschüttende Klasse USD I5*	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD X*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	135.441 \$	10,42 \$	15.554 \$	9,72 \$	1.118.898 \$	11,16 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z*	Thesaurierende Klasse USD Z*
	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–
31. Dezember 2021	–	–
31. Dezember 2020	6.767.741 \$	11,52 \$

\*\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Global Equity Megatrends

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD C1
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	5.374.723 €	13,68 €	33.770.046 \$	12,43 \$	3.586.666 \$	11,87 \$
31. Dezember 2021	2.781.561 €	15,15 €	33.387.264 \$	14,54 \$	4.271.651 \$	14,03 \$
31. Dezember 2020	507.201 €	12,13 €	14.689.207 \$	12,42 \$	4.209.720 \$	12,10 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	9.729.597 \$	13,01 \$	17.646.556 \$	11,90 \$	8.879.110 \$	8,77 \$
31. Dezember 2021	19.765.635 \$	15,09 \$	22.544.188 \$	14,04 \$	–	–
31. Dezember 2020	1.860.540 \$	12,76 \$	6.229.691 \$	12,10 \$	–	–

## Global Flexible Credit Income

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CAD I5* NIW	Thesaurierende Klasse CAD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	14.013.104 CAD	9,34 CAD	3.643.959 €	9,69 €	–	–
31. Dezember 2021	15.582.329 CAD	10,39 CAD	3.296.205 €	11,01 €	–	–
31. Dezember 2020	–	–	3.640.342 €	10,77 €	23.086.291 €	11,12 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	390.568 €	9,25 €	196.137.415 £	10,49 £	9.127.970 \$	9,74 \$
31. Dezember 2021	411.798 €	10,67 €	386.920.465 £	11,70 £	10.681.489 \$	10,88 \$
31. Dezember 2020	53.198 €	10,58 €	414.183.815 £	11,33 £	10.611 \$	10,61 \$



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
Geschäftsjahr zum						
31. Dezember 2022	123.697.450 \$	10,54 \$	333.308 \$	9,53 \$	5.552.804 \$	9,56 \$
31. Dezember 2021	136.359.008 \$	11,70 \$	432.340 \$	11,09 \$	6.153.911 \$	10,76 \$
31. Dezember 2020	34.034 \$	11,34 \$	87.022 \$	11,21 \$	10.586 \$	10,59 \$

	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
Geschäftsjahr zum		
31. Dezember 2022	5.191.915 \$	10,70 \$
31. Dezember 2021	10.994.680 \$	11,81 \$
31. Dezember 2020	10.601.478 \$	11,38 \$

Global High Yield SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD I* NIW	Ausschüttende Klasse AUD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I4* NIW	Ausschüttende Klasse CHF I4* NIW je Anteil
Geschäftsjahr zum						
31. Dezember 2022	39.517 AUD	9,36 AUD	34.903.208 CHF	9,53 CHF	2.109.781 CHF	9,32 CHF

	Thesaurierende Klasse CHF X* NIW	Thesaurierende Klasse CHF X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW je Anteil
Geschäftsjahr zum						
31. Dezember 2022	27.818 CHF	9,49 CHF	34.350.965 €	9,51 €	894.723 €	9,30 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	26.930 €	9,46 €	21.835.394 €	10,68 €	8.029.261 £	9,63 £
31. Dezember 2021	–	–	24.099.127 €	12,25 €	–	–
31. Dezember 2020	–	–	24.022.813 €	11,85 €	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	23.001 £	9,59 £	600.599 \$	11,29 \$	–	–
31. Dezember 2021	–	–	878.851 \$	12,78 \$	–	–
31. Dezember 2020	–	–	11.928.181 \$	12,39 \$	458.711 \$	10,71 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	82.906 \$	11,86 \$	93.240.963 \$	9,70 \$	–	–
31. Dezember 2021	127.787 \$	13,35 \$	–	–	–	–
31. Dezember 2020	5.528.823 \$	12,87 \$	–	–	59.581 \$	10,83 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P*	Thesaurierende Klasse USD P*	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD X
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.212.483 \$	7,72 \$	–	–	19.180 \$	9,53 \$
31. Dezember 2021	2.149.362 \$	9,32 \$	–	–	10.756 \$	10,76 \$
31. Dezember 2020	1.576.353 \$	9,63 \$	13.341 \$	11,67 \$	10.324 \$	10,32 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse USD Z
	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.101.529 \$	12,32 \$
31. Dezember 2021	9.055.187 \$	13,79 \$
31. Dezember 2020	14.453.332 \$	13,21 \$

Global High Yield Sustainable Action

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD X
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	9.396 \$	9,40 \$	12.286.350 \$	8,43 \$	9.281 \$	9,28 \$
31. Dezember 2021	10.624 \$	10,62 \$	14.496.421 \$	9,94 \$	10.453 \$	10,45 \$
31. Dezember 2020	10.335 \$	10,33 \$	14.648.526 \$	10,05 \$	10.128 \$	10,13 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Sustainable Action (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.739.164 \$	9,13 \$
31. Dezember 2021	3.084.210 \$	10,28 \$

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.224.588 \$	8,44 \$	42.337.788 \$	8,46 \$	42.354.407 \$	8,47 \$
31. Dezember 2021	9.876 \$	9,88 \$	49.426.204 \$	9,88 \$	49.408.813 \$	9,89 \$

## Global Opportunistic Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.432.665 €	8,72 €	21.356 £	9,31 £	481.764 \$	10,22 \$
31. Dezember 2021	4.580.004 €	10,08 €	24.292 £	10,59 £	764.522 \$	11,59 \$
31. Dezember 2020	9.157.786 €	10,07 €	24.125 £	10,51 £	912.261 \$	11,54 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	4.135.327 \$	10,91 \$	8.952.587 \$	9,50 \$
31. Dezember 2021	–	–	13.048.644 \$	12,32 \$	10.384.711 \$	11,02 \$
31. Dezember 2020	317.391 \$	10,67 \$	16.570.999 \$	12,22 \$	5.596.724 \$	11,21 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	24.678.158 \$	10,32 \$	–	–	28.817.657 \$	10,04 \$
31. Dezember 2021	26.442.006 \$	11,65 \$	883.229 \$	10,56 \$	37.475.394 \$	11,31 \$
31. Dezember 2020	27.033.566 \$	11,55 \$	835.308 \$	10,57 \$	35.324.358 \$	11,17 \$

Global Real Estate Securities

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	9.028.171 €	7,69 €	1.021.424 €	9,87 €	103.583 €	11,25 €
31. Dezember 2021	8.785.756 €	10,86 €	1.405.014 €	13,96 €	119.721 €	14,07 €
31. Dezember 2020	–	–	234.265 €	11,24 €	79.405 €	10,17 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD CI NIW	Thesaurierende Klasse USD CI NIW je Anteil
31. Dezember 2022	83.075 £	11,37 £	4.298.698 \$	9,83 \$	128.352 \$	8,77 \$
31. Dezember 2021	108.494 £	15,48 £	6.500.961 \$	13,30 \$	212.935 \$	11,98 \$
31. Dezember 2020	82.363 £	12,10 £	2.408.265 \$	10,50 \$	105.046 \$	9,55 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	16.657.145 \$	12,55 \$	–	–	2.824.490 \$	8,82 \$
31. Dezember 2021	20.434.205 \$	16,86 \$	–	–	3.851.557 \$	12,03 \$
31. Dezember 2020	2.811.248 \$	13,21 \$	591.304 \$	11,70 \$	31.948 \$	9,64 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	672.248 \$	8,99 \$	3.549.409 \$	12,81 \$
31. Dezember 2021	1.977.571 \$	12,29 \$	6.105.329 \$	17,07 \$
31. Dezember 2020	57.276 \$	9,79 \$	130.210 \$	13,27 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity<sup>2</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	79.067.463 €	10,10 €	59.173 €	9,73 €	1.214.656 €	9,75 €
31. Dezember 2021	111.148.483 €	13,18 €	65.402 €	12,96 €	1.610.088 €	12,68 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	526.524 £	9,85 £	4.009.524 £	9,90 £	523.329 \$	7,28 \$
31. Dezember 2021	8.807 £	12,20 £	8.837 £	12,22 £	39.703 \$	10,24 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	10.623.061 \$	8,83 \$	4.393.504 \$	8,84 \$	361.394 \$	8,54 \$
31. Dezember 2021	24.053.208 \$	12,33 \$	34.904.983 \$	12,33 \$	16.681.154 \$	12,10 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	24.466.171 \$	8,32 \$
31. Dezember 2021	–	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD A NIW	Thesaurierende Klasse AUD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	18.826.339 AUD	6,43 AUD	3.345.436 AUD	13,78 AUD	14.918.035 AUD	4,95 AUD
31. Dezember 2021	25.718.582 AUD	7,91 AUD	5.613.157 AUD	15,93 AUD	28.237.139 AUD	6,24 AUD
31. Dezember 2020	29.282.032 AUD	8,11 AUD	7.280.415 AUD	15,39 AUD	56.504.465 AUD	6,58 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	907.067 AUD	8,71 AUD	422.009 AUD	4,96 AUD	961.233 AUD	5,00 AUD
31. Dezember 2021	1.558.874 AUD	10,24 AUD	1.062.589 AUD	6,25 AUD	2.851.099 AUD	6,30 AUD
31. Dezember 2020	49.232 AUD	10,06 AUD	2.313.495 AUD	6,59 AUD	7.914.460 AUD	6,63 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD I NIW	Ausschüttende Klasse AUD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	394.034 AUD	9,82 AUD	24.632.173 AUD	9,15 AUD	77.779.276 AUD	5,71 AUD
31. Dezember 2021	2.148.334 AUD	11,54 AUD	68.318.695 AUD	11,10 AUD	103.756.407 AUD	7,13 AUD
31. Dezember 2020	1.560.697 AUD	11,33 AUD	99.329.604 AUD	11,18 AUD	106.128.062 AUD	7,43 AUD



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	790.496 AUD	5,52 AUD	2.009.139 AUD	11,83 AUD	6.486.618 CAD	6,61 CAD
31. Dezember 2021	1.233.271 AUD	6,89 AUD	1.334.710 AUD	13,75 AUD	10.968.503 CAD	8,06 CAD
31. Dezember 2020	1.564.842 AUD	7,18 AUD	2.198.718 AUD	13,37 AUD	3.406.278 CAD	8,26 CAD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I* NIW	Ausschüttende Klasse CHF I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.669.718 CHF	11,47 CHF	5.277.144 CHF	12,22 CHF	–	–
31. Dezember 2021	5.323.617 CHF	13,46 CHF	678.236 CHF	14,25 CHF	–	–
31. Dezember 2020	5.299.026 CHF	13,10 CHF	832.489 CHF	13,78 CHF	178.640 CHF	7,84 CHF

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CNY A (Wöchentlich)* NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Wöchentlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.843.440 CHF	10,47 CHF	14.058.980 CNY	73,25 CNY	–	–
31. Dezember 2021	2.608.938 CHF	12,20 CHF	18.648.136 CNY	89,36 CNY	–	–
31. Dezember 2020	1.453.452 CHF	11,79 CHF	16.739.363 CNY	90,13 CNY	3.958.751 CNY	87,94 CNY

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CNY T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY T (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	207.631 CNY	77,39 CNY	–	–	6.420.394 €	6,03 €
31. Dezember 2021	17.018.798 CNY	93,83 CNY	–	–	10.909.966 €	7,53 €
31. Dezember 2020	6.659.000 CNY	94,08 CNY	546.326 CNY	80,67 CNY	7.561.674 €	7,76 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A NIW	Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	20.497.963 €	18,42 €	2.934.472 €	7,01 €	21.263.684 €	16,30 €
31. Dezember 2021	29.425.571 €	21,61 €	3.944.868 €	8,62 €	23.795.414 €	19,02 €
31. Dezember 2020	32.060.845 €	20,99 €	4.556.287 €	8,73 €	28.972.814 €	18,35 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	5.068.640 €	6,74 €	21.766.293 €	11,44 €	37.930.088 €	6,65 €
31. Dezember 2021	12.460.480 €	8,30 €	19.114.240 €	13,33 €	1.155.752 €	8,19 €
31. Dezember 2020	14.943.513 €	8,40 €	15.605.683 €	12,86 €	47.577.439 €	8,29 €

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR M* NIW	Ausschüttende Klasse EUR M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	40.548 €	10,36 €	–	–
31. Dezember 2021	178.350.768 €	10,72 €	36.027 €	12,23 €	–	–
31. Dezember 2020	167.259.251 €	10,31 €	70.061 €	11,94 €	100.694 €	9,06 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP A NIW	Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	165.274 €	10,87 €	2.614.675 £	6,20 £	1.624.325 £	12,91 £
31. Dezember 2021	191.608 €	12,60 €	5.971.923 £	7,60 £	1.923.551 £	14,87 £
31. Dezember 2020	197.680 €	12,09 €	9.310.640 £	7,79 £	2.045.374 £	14,35 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP A NIW	Ausschüttende Klasse GBP A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.085.076 £	7,59 £	5.660.368 £	15,62 £	7.234.066 £	8,21 £
31. Dezember 2021	1.639.261 £	9,18 £	6.489.882 £	17,89 £	16.481.165 £	9,93 £
31. Dezember 2020	2.262.963 £	9,23 £	6.549.702 £	17,16 £	19.389.640 £	9,98 £

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	581.131 £	12,49 £	123.006.920 £	7,27 £	153.131 £	12,06 £
31. Dezember 2021	754.148 £	14,29 £	28.016.548 £	8,79 £	91.103 £	13,72 £
31. Dezember 2020	2.715.804 £	13,70 £	226.800.654 £	8,85 £	190.625 £	13,08 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse HKD A* NIW	Thesaurierende Klasse HKD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	38.478.810 HKD	6,53 HKD	–	–	78.792.625 SEK	125,59 SEK
31. Dezember 2021	50.388.746 HKD	7,97 HKD	–	–	101.874.300 SEK	146,45 SEK
31. Dezember 2020	61.176.263 HKD	8,15 HKD	2.947.406 HKD	13,68 HKD	140.173.288 SEK	141,69 SEK

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	22.367.741 SGD	13,65 SGD	2.875.654 SGD	26,58 SGD	93.381.210 \$	6,93 \$
31. Dezember 2021	32.504.626 SGD	16,64 SGD	3.883.139 SGD	30,46 SGD	160.083.379 \$	8,42 \$
31. Dezember 2020	23.053.125 SGD	17,02 SGD	3.847.907 SGD	29,34 SGD	127.337.025 \$	8,61 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.844.055 \$	6,65 \$	137.066.692 \$	16,32 \$	20.742.314 \$	8,20 \$
31. Dezember 2021	2.280.972 \$	8,07 \$	201.215.637 \$	18,63 \$	35.473.177 \$	9,80 \$
31. Dezember 2020	2.745.485 \$	8,25 \$	229.793.610 \$	17,94 \$	30.252.626 \$	9,83 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C NIW	Thesaurierende Klasse USD C NIW je Anteil
31. Dezember 2022	111.013.457 \$	5,38 \$	12.754.653 \$	10,88 \$	894.416 \$	12,07 \$
31. Dezember 2021	173.623.426 \$	6,70 \$	20.260.951 \$	12,61 \$	1.176.654 \$	13,86 \$
31. Dezember 2020	145.918.003 \$	7,03 \$	10.856.476 \$	12,34 \$	1.537.238 \$	13,43 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD C* NIW	Ausschüttende Klasse USD C* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	2.598.086 \$	9,85 \$	612.205 \$	8,29 \$
31. Dezember 2021	–	–	3.629.287 \$	11,36 \$	885.749 \$	9,90 \$
31. Dezember 2020	130.310 \$	9,63 \$	6.930.042 \$	11,04 \$	912.572 \$	9,94 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.605.063 \$	5,38 \$	2.346.023 \$	10,89 \$	11.744.149 \$	5,46 \$
31. Dezember 2021	8.209.587 \$	6,70 \$	3.518.498 \$	12,63 \$	19.267.884 \$	6,79 \$
31. Dezember 2020	8.873.363 \$	7,03 \$	1.676.881 \$	12,35 \$	24.257.744 \$	7,13 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.696.286 \$	9,81 \$	56.976.570 \$	7,20 \$	420.046.688 \$	24,73 \$
31. Dezember 2021	3.591.490 \$	11,38 \$	96.952.330 \$	8,69 \$	491.357.430 \$	28,05 \$
31. Dezember 2020	3.061.840 \$	11,13 \$	29.880.680 \$	8,84 \$	589.598.458 \$	26,84 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	19.820.534 \$	9,48 \$	53.570.112 \$	8,09 \$	265.106.976 \$	13,53 \$
31. Dezember 2021	50.607.421 \$	11,34 \$	71.642.859 \$	9,76 \$	421.521.968 \$	15,33 \$
31. Dezember 2020	45.545.960 \$	11,37 \$	59.161.744 \$	9,90 \$	433.118.997 \$	14,65 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	156.239.569 \$	7,91 \$	124.143.845 \$	8,88 \$	553.297 \$	12,12 \$
31. Dezember 2021	101.965.510 \$	9,46 \$	190.867.412 \$	10,56 \$	685.349 \$	13,92 \$
31. Dezember 2020	200.788.366 \$	9,49 \$	170.401.537 \$	10,53 \$	907.308 \$	13,48 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	164.387 \$	7,79 \$	4.400.603 \$	10,67 \$	138.874.267 \$	5,95 \$
31. Dezember 2021	396.356 \$	9,49 \$	8.046.885 \$	12,10 \$	184.244.304 \$	7,33 \$
31. Dezember 2020	809.598 \$	9,71 \$	5.793.338 \$	11,58 \$	177.025.571 \$	7,61 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.835.534 \$	5,99 \$	7.598.079 \$	12,02 \$	742.761 \$	6,77 \$
31. Dezember 2021	2.475.154 \$	7,37 \$	9.902.784 \$	13,80 \$	899.075 \$	8,20 \$
31. Dezember 2020	3.076.111 \$	7,66 \$	6.742.373 \$	13,37 \$	916.353 \$	8,35 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich)*
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	11.371.297 \$	13,22 \$	64.829.210 \$	12,65 \$	–	–
31. Dezember 2021	15.400.385 \$	15,05 \$	79.110.967 \$	14,26 \$	–	–
31. Dezember 2020	13.134.779 \$	14,44 \$	61.065.100 \$	13,57 \$	9.946.011 ZAR	80,72 ZAR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	372.548.933 ZAR	53,76 ZAR	7.199.304 ZAR	53,71 ZAR	71.672.740 ZAR	53,15 ZAR
31. Dezember 2021	696.637.863 ZAR	67,31 ZAR	20.557.931 ZAR	67,24 ZAR	155.721.676 ZAR	66,55 ZAR
31. Dezember 2020	829.238.274 ZAR	70,61 ZAR	56.831.637 ZAR	70,54 ZAR	249.534.827 ZAR	69,81 ZAR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR E	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR T	Thesaurierende Klasse ZAR T
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	9.921.353 ZAR	148,94 ZAR	1.678.189.332 ZAR	59,48 ZAR	15.485.308 ZAR	137,52 ZAR
31. Dezember 2021	19.063.973 ZAR	166,84 ZAR	2.264.598.515 ZAR	73,73 ZAR	23.982.306 ZAR	152,51 ZAR
31. Dezember 2020	20.837.715 ZAR	155,94 ZAR	2.521.720.719 ZAR	76,58 ZAR	31.369.583 ZAR	141,13 ZAR



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	469.743 CHF	6,39 CHF	282.274 €	6,32 €	810.342 €	6,42 €
31. Dezember 2021	1.038.996 CHF	10,86 CHF	135.730 €	10,82 €	1.024.161 €	10,88 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	29.209 €	7,58 €	3.134.258 €	6,33 €	26.331 SGD	12,97 SGD
31. Dezember 2021	30.846 €	11,94 €	5.357.398 €	10,83 €	44.171 SGD	21,75 SGD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SGD I4* NIW	Thesaurierende Klasse SGD I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD X* NIW	Thesaurierende Klasse SGD X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	696.450 SGD	13,20 SGD	343.196 SGD	13,02 SGD	125.519 \$	6,55 \$
31. Dezember 2021	1.144.153 SGD	21,88 SGD	573.039 SGD	21,78 SGD	274.762 \$	10,90 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.159.260 \$	6,64 \$	3.888.909 \$	6,67 \$	6.265 \$	6,26 \$
31. Dezember 2021	5.210.923 \$	10,95 \$	8.314.820 \$	10,97 \$	10.508 \$	10,51 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup> (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.765.309 \$	6,58 \$
31. Dezember 2021	3.123.295 \$	10,92 \$

## Japan Equity Engagement

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	60.111.478 €	9,46 €	321.237 £	8,13 £	17.700 £	7,89 £
31. Dezember 2021	–	–	279.974 £	9,34 £	21.052 £	9,39 £

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse JPY I NIW	Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I5* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	503.411.392 ¥	1.450,08 ¥	735.824.128 ¥	1.450,06 ¥	6.320.326.223 ¥	9.380,86 ¥
31. Dezember 2021	553.780.013 ¥	1.689,60 ¥	7.193.678.670 ¥	1.689,60 ¥	5.549.922.666 ¥	10.883,95 ¥
31. Dezember 2020	4.452.826 ¥	1.484,28 ¥	737.686.416 ¥	1.484,28 ¥	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW	Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.464.613.674 ¥	922,43 ¥
31. Dezember 2021	142.656.638 ¥	1.065,69 ¥

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.066.163 €	9,23 €	–	–	162.743 £	9,71 £
31. Dezember 2021	5.243.651 €	9,47 €	26.625 €	9,68 €	163.106 £	9,73 £
31. Dezember 2020	407.052 €	9,70 €	27.574 €	10,03 €	354.315 £	9,84 £

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK I NIW	Thesaurierende Klasse SEK I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SEK I* NIW	Ausschüttende Klasse SEK I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	263.295.231 SEK	93,64 SEK	72.218 SEK	96,89 SEK	10.440 \$	9,66 \$
31. Dezember 2021	224.458.577 SEK	95,49 SEK	21.475.977 SEK	98,77 SEK	10.496 \$	9,71 \$
31. Dezember 2020	5.339.313 SEK	97,37 SEK	275.530 SEK	97,37 SEK	29.604 \$	9,87 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	6.993.860 \$	9,84 \$
31. Dezember 2021	12.682.478 \$	9,80 \$	4.659.851 \$	9,84 \$
31. Dezember 2020	21.083.766 \$	9,91 \$	9.409.030 \$	9,93 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Multi-Asset Income

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR A* NIW	Ausschüttende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	632.450 €	10,95 €	–	–
31. Dezember 2020	25.728 €	9,62 €	443.312 €	10,29 €	240.276 €	9,98 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M* NIW	Ausschüttende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP P NIW	Ausschüttende Klasse GBP P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	19.140 £	8,21 £	6.738.767 \$	10,32 \$
31. Dezember 2021	–	–	23.306 £	10,00 £	7.690.451 \$	11,79 \$
31. Dezember 2020	35.991 €	8,68 €	23.159 £	9,93 £	4.990.572 \$	11,05 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.328.953 \$	9,89 \$	685.261 \$	11,59 \$	107.660 \$	8,72 \$
31. Dezember 2021	3.338.236 \$	11,40 \$	1.426.794 \$	13,15 \$	230.204 \$	10,51 \$
31. Dezember 2020	3.921.269 \$	10,80 \$	5.774.974 \$	12,25 \$	181.194 \$	10,42 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	1.477.940 \$	10,04 \$
31. Dezember 2021	6.841.262 \$	10,08 \$	2.435.670 \$	11,56 \$
31. Dezember 2020	–	–	2.390.101 \$	10,93 \$

Multi-Style Premia\*\*

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2020	23.772 \$	7,92 \$	8.619.709 \$	7,86 \$	908.272 \$	7,58 \$

\*\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

Next Generation Mobility

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	132.041 €	11,62 €	269.618 €	8,21 €	36.872.226 €	13,43 €
31. Dezember 2021	218.365 €	16,56 €	4.751.960 €	11,60 €	43.990.496 €	17,08 €
31. Dezember 2020	140.785 €	13,62 €	–	–	7.751.362 €	12,80 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	30.152.894 €	15,72 €	26.824.764 \$	13,10 \$	1.947.673 \$	14,16 \$
31. Dezember 2021	36.913.115 €	20,33 €	34.030.030 \$	17,91 \$	4.295.234 \$	19,54 \$
31. Dezember 2020	14.972.550 €	15,49 €	13.736.898 \$	14,57 \$	2.585.658 \$	16,06 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.906.268 \$	13,25 \$	5.581.715 \$	13,24 \$	7.055.187 \$	14,25 \$
31. Dezember 2021	16.707.928 \$	17,96 \$	9.527.770 \$	17,94 \$	11.564.452 \$	19,64 \$
31. Dezember 2020	8.318.637 \$	14,48 \$	19.776.005 \$	14,47 \$	1.282.877 \$	16,11 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2022	29.578.839 \$	15,48 \$
31. Dezember 2021	46.685.234 \$	21,13 \$
31. Dezember 2020	3.832.201 \$	17,16 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.206.616 €	9,51 €	1.061.485 €	9,39 €	2.882.343 \$	9,61 \$

Short Duration Emerging Market Debt

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.610.697 AUD	7,91 AUD	4.375.456 CAD	8,21 CAD	4.483.337 CHF	9,23 CHF
31. Dezember 2021	2.969.460 AUD	9,04 AUD	4.970.148 CAD	9,33 CAD	6.727.866 CHF	10,23 CHF
31. Dezember 2020	1.798.470 AUD	9,53 AUD	481.721 CAD	9,82 CAD	7.327.930 CHF	10,39 CHF

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CHF A NIW	Ausschüttende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I NIW	Ausschüttende Klasse CHF I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	824.695 CHF	6,80 CHF	12.634.709 CHF	9,64 CHF	1.149.563 CHF	6,82 CHF
31. Dezember 2021	924.838 CHF	7,79 CHF	16.005.206 CHF	10,63 CHF	871.394 CHF	7,82 CHF
31. Dezember 2020	1.158.013 CHF	8,17 CHF	14.259.969 CHF	10,74 CHF	10.971.944 CHF	8,20 CHF

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I2 NIW	Ausschüttende Klasse CHF I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I5 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	19.647.200 CHF	9,84 CHF	12.395.410 CHF	7,49 CHF	1.515.754 CHF	10,02 CHF
31. Dezember 2021	3.566.030 CHF	10,84 CHF	14.461.747 CHF	8,58 CHF	4.483.203 CHF	11,03 CHF
31. Dezember 2020	4.944.829 CHF	10,94 CHF	14.666.206 CHF	9,00 CHF	4.398.433 CHF	11,12 CHF

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF P NIW	Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF P* NIW	Ausschüttende Klasse CHF P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	27.905.942 CHF	9,32 CHF	–	–	117.630.713 €	9,55 €
31. Dezember 2021	41.732.801 CHF	10,27 CHF	–	–	166.225.000 €	10,55 €
31. Dezember 2020	39.861.743 CHF	10,38 CHF	11.469 CHF	9,21 CHF	190.191.153 €	10,70 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR A NIW	Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	16.574.105 €	7,04 €	712.003.973 €	9,98 €	–	–
31. Dezember 2021	21.287.062 €	8,05 €	1.145.591.264 €	10,97 €	–	–
31. Dezember 2020	21.393.422 €	8,42 €	886.467.983 €	11,07 €	25.683 €	10,00 €



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	163.594.524 €	7,05 €	214.675.538 €	10,06 €	59.488.811 €	7,63 €
31. Dezember 2021	167.167.694 €	8,05 €	116.405.182 €	11,05 €	14.135.350 €	8,72 €
31. Dezember 2020	201.037.419 €	8,43 €	119.441.218 €	11,13 €	133.861.145 €	9,13 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	6.256.930 €	10,43 €	2.699.887 €	9,33 €	1.109.542 €	6,79 €
31. Dezember 2021	6.699.994 €	11,44 €	3.298.298 €	10,36 €	1.435.772 €	7,89 €
31. Dezember 2020	7.552.436 €	11,51 €	4.182.226 €	10,57 €	1.533.804 €	8,40 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR P NIW	Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR U NIW	Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR X NIW	Ausschüttende Klasse EUR X NIW je Anteil
31. Dezember 2022	108.476.284 €	9,56 €	3.889.492 €	9,49 €	49.291.318 €	8,80 €
31. Dezember 2021	138.193.010 €	10,51 €	5.738.266 €	10,45 €	56.344.451 €	10,06 €
31. Dezember 2020	109.768.538 €	10,60 €	2.115.116 €	10,57 €	58.975.421 €	10,53 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP A NIW	Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	1.784.594 £	10,00 £	4.696.255 £	10,30 £	3.745.024 £	8,30 £
31. Dezember 2021	1.987.812 £	10,87 £	4.507.349 £	11,14 £	5.216.500 £	9,34 £
31. Dezember 2020	2.957.007 £	10,95 £	6.230.959 £	11,16 £	5.640.512 £	9,71 £

	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I5 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I5 NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	2.008.405 £	10,29 £	504.532.899 £	8,15 £	130.424.601 £	7,66 £
31. Dezember 2021	5.180.160 £	11,12 £	540.540.207 £	9,17 £	112.065.803 £	8,62 £
31. Dezember 2020	4.230.950 £	11,13 £	458.560.656 £	9,54 £	106.630.589 £	8,96 £

	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	1.656.455 £	9,67 £	–	–	90.490.215.829 ¥	1.024,16 ¥
31. Dezember 2021	626.791 £	10,45 £	276.207 £	9,69 £	102.280.856.951 ¥	1.126,55 ¥
31. Dezember 2020	268.403 £	10,48 £	–	–	99.795.123.604 ¥	1.131,21 ¥

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse JPY I NIW	Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.875.746.192 ¥	719,95 ¥	15.573.259 SEK	93,27 SEK	40.192.701 SGD	16,13 SGD
31. Dezember 2021	9.105.341.406 ¥	824,34 ¥	25.446.053 SEK	102,60 SEK	39.123.251 SGD	18,32 SGD
31. Dezember 2020	7.388.015.887 ¥	859,14 ¥	19.216.155 SEK	103,67 SEK	30.465.526 SGD	19,26 SGD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	23.230.997 \$	8,19 \$	412.842.165 \$	11,29 \$	119.519.572 \$	8,11 \$
31. Dezember 2021	28.852.590 \$	9,29 \$	623.897.960 \$	12,21 \$	193.379.775 \$	9,07 \$
31. Dezember 2020	9.609.587 \$	9,77 \$	575.156.722 \$	12,28 \$	163.593.735 \$	9,41 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	37.919.286 \$	9,72 \$	3.929.202 \$	8,57 \$	741.407.065 \$	11,79 \$
31. Dezember 2021	56.209.098 \$	10,62 \$	5.582.169 \$	9,58 \$	1.145.025.152 \$	12,69 \$
31. Dezember 2020	69.354.598 \$	10,79 \$	6.737.750 \$	9,94 \$	701.373.870 \$	12,69 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	81.356.489 \$	8,62 \$	159.773.031 \$	11,58 \$	88.468.242 \$	8,61 \$
31. Dezember 2021	213.794.766 \$	9,64 \$	125.167.562 \$	12,45 \$	119.540.024 \$	9,63 \$
31. Dezember 2020	178.313.281 \$	10,00 \$	87.918.158 \$	12,44 \$	80.733.046 \$	9,99 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	5.538.850 \$	11,98 \$	21.165.474 \$	8,25 \$	42.163.321 \$	9,94 \$
31. Dezember 2021	6.969.453 \$	12,86 \$	15.690.435 \$	9,23 \$	53.640.766 \$	10,82 \$
31. Dezember 2020	7.189.358 \$	12,83 \$	6.190.819 \$	9,57 \$	57.279.925 \$	10,94 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	9.583.244 \$	7,84 \$	188.567.221 \$	11,42 \$	14.055.349 \$	12,18 \$
31. Dezember 2021	9.357.852 \$	8,92 \$	204.528.127 \$	12,29 \$	26.986.290 \$	13,04 \$
31. Dezember 2020	9.933.247 \$	9,41 \$	101.179.974 \$	12,29 \$	18.067.663 \$	12,98 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.192.743 AUD	7,08 AUD	790.227 CHF	10,75 CHF	227.034 CHF	11,64 CHF
31. Dezember 2021	485.095 AUD	7,96 AUD	921.175 CHF	11,58 CHF	243.222 CHF	12,47 CHF
31. Dezember 2020	421.550 AUD	8,17 AUD	1.173.975 CHF	11,33 CHF	879.040 CHF	12,12 CHF

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A NIW	Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.048.761 CNY	84,25 CNY	11.761.196 €	11,29 €	2.515.236 €	6,76 €
31. Dezember 2021	2.153.866 CNY	94,05 CNY	15.735.732 €	12,13 €	2.971.545 €	7,61 €
31. Dezember 2020	2.030.099 CNY	94,90 CNY	15.430.284 €	11,84 €	5.000.813 €	7,75 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	39.889.511 €	12,03 €	5.785.967 €	11,15 €	–	–
31. Dezember 2021	56.858.937 €	12,85 €	1.046.828 €	11,90 €	–	–
31. Dezember 2020	22.164.342 €	12,47 €	2.555.885 €	11,53 €	563.374 €	7,69 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	922.543 €	10,01 €	630.438 €	6,83 €
31. Dezember 2021	–	–	1.703.444 €	10,82 €	673.825 €	7,85 €
31. Dezember 2020	223.419.619 €	8,80 €	989.079 €	10,63 €	976.746 €	8,15 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	15.610.824 £	13,18 £	2.403.578 £	7,53 £	1.217.801 £	12,24 £
31. Dezember 2021	17.464.841 £	13,86 £	9.441.941 £	8,37 £	1.364.744 £	12,86 £
31. Dezember 2020	11.902.323 £	13,37 £	4.217.647 £	8,46 £	1.314.244 £	12,39 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.385.249 £	7,34 £	2.368.192 HKD	9,97 HKD	17.584.604.152 ¥	1.205,68 ¥
31. Dezember 2021	3.963.818 £	8,15 £	–	–	18.139.086.488 ¥	1.288,30 ¥
31. Dezember 2020	5.606.544 £	8,24 £	–	–	21.575.048.856 ¥	1.244,42 ¥

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse JPY I* NIW	Ausschüttende Klasse JPY I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.522.033.806 ¥	1.014,69 ¥	2.179.241 SGD	14,86 SGD	3.099.464 \$	7,57 \$
31. Dezember 2021	–	–	1.330.294 SGD	16,57 SGD	4.487.058 \$	8,41 \$
31. Dezember 2020	–	–	324.214 SGD	16,95 SGD	2.174.348 \$	8,60 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C* NIW	Thesaurierende Klasse USD C* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	35.220.346 \$	13,11 \$	9.519.536 \$	7,91 \$	–	–
31. Dezember 2021	39.948.103 \$	13,77 \$	9.670.590 \$	8,70 \$	–	–
31. Dezember 2020	33.694.602 \$	13,33 \$	9.984.212 \$	8,78 \$	122.481 \$	11,97 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD C* NIW	Ausschüttende Klasse USD C* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	3.953.039 \$	10,26 \$	121.367.229 \$	14,00 \$
31. Dezember 2021	–	–	4.728.605 \$	10,89 \$	104.831.003 \$	14,61 \$
31. Dezember 2020	148.740 \$	8,84 \$	7.435.510 \$	10,65 \$	210.699.468 \$	14,06 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.566.217 \$	8,09 \$	94.032.462 \$	13,11 \$	1.874.619 \$	7,90 \$
31. Dezember 2021	54.497.667 \$	8,87 \$	114.549.884 \$	13,68 \$	2.373.346 \$	8,69 \$
31. Dezember 2020	61.898.208 \$	8,98 \$	6.818.566 \$	13,15 \$	2.056.340 \$	8,77 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	25.249.794 \$	10,04 \$	8.383.843 \$	10,55 \$	3.564.599 \$	8,00 \$
31. Dezember 2021	–	–	3.113.815 \$	11,15 \$	1.043.541 \$	8,97 \$
31. Dezember 2020	–	–	3.415.525 \$	10,86 \$	1.191.307 \$	9,24 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	9.845.241 \$	12,64 \$
31. Dezember 2021	11.252.560 \$	13,12 \$
31. Dezember 2020	12.727.499 \$	12,55 \$



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.816.128 AUD	8,10 AUD	74.440.920 AUD	8,74 AUD	6.586.578 €	7,56 €
31. Dezember 2021	5.634.916 AUD	9,56 AUD	24.618.870 AUD	10,22 AUD	10.163.081 €	9,04 €
31. Dezember 2020	7.326.089 AUD	9,77 AUD	7.815.793 AUD	10,34 AUD	9.628.899 €	9,30 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	54.250 €	10,05 €	7.002.752 €	10,68 €	1.332.181 €	9,85 €
31. Dezember 2021	–	–	6.916.215 €	12,18 €	2.513.964 €	11,36 €
31. Dezember 2020	469.888 €	11,65 €	4.752.741 €	11,97 €	2.333.988 €	11,28 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M* NIW	Ausschüttende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	1.790.460 £	7,95 £	11.395.657 HKD	8,31 HKD
31. Dezember 2021	–	–	3.137.215 £	9,36 £	19.938.038 HKD	9,76 HKD
31. Dezember 2020	266.466 €	9,50 €	2.671.416 £	9,56 £	7.298.799 HKD	9,95 HKD

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW	Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW je Anteil
31. Dezember 2022	12.532.729.742 ¥	1.065,57 ¥	3.890.984.078 ¥	1.656,82 ¥	5.903.832.844 ¥	875,62 ¥
31. Dezember 2021	15.036.546.020 ¥	1.216,93 ¥	3.786.009.340 ¥	1.610,18 ¥	6.698.942.854 ¥	1.001,03 ¥
31. Dezember 2020	11.738.138.687 ¥	1.189,95 ¥	3.310.196.302 ¥	1.406,02 ¥	7.102.275.697 ¥	1.061,30 ¥

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse JPY I NIW	Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW	Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	7.335.571.257 ¥	803,30 ¥	10.051.163.176 ¥	915,43 ¥	22.557.538 SGD	15,90 SGD
31. Dezember 2021	8.627.434.436 ¥	944,76 ¥	–	–	32.262.797 SGD	18,64 SGD
31. Dezember 2020	8.729.105.220 ¥	955,90 ¥	–	–	29.049.120 SGD	18,99 SGD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.409.893 SGD	20,36 SGD	11.455.558 SGD	17,69 SGD	39.825.935 \$	8,11 \$
31. Dezember 2021	7.722.945 SGD	22,86 SGD	7.693.639 SGD	20,62 SGD	66.114.445 \$	9,47 \$
31. Dezember 2020	3.048.196 SGD	22,39 SGD	4.684.381 SGD	20,91 SGD	46.140.978 \$	9,65 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	302.568.244 \$	11,37 \$	15.250.191 \$	9,39 \$	43.957.466 \$	9,99 \$
31. Dezember 2021	324.229.247 \$	12,72 \$	17.807.491 \$	10,75 \$	74.844.054 \$	11,29 \$
31. Dezember 2020	271.358.679 \$	12,45 \$	10.490.629 \$	10,83 \$	69.177.066 \$	11,17 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	369.131.042 \$	12,27 \$	25.395.713 \$	9,43 \$	70.446.108 \$	11,36 \$
31. Dezember 2021	410.581.638 \$	13,67 \$	26.561.963 \$	10,80 \$	81.107.940 \$	12,79 \$
31. Dezember 2020	328.309.066 \$	13,31 \$	19.332.894 \$	10,88 \$	61.890.847 \$	12,59 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.239.009 \$	8,30 \$	42.846.054 \$	12,39 \$
31. Dezember 2021	9.575.854 \$	9,69 \$	51.445.533 \$	13,72 \$
31. Dezember 2020	6.824.681 \$	9,94 \$	56.112.017 \$	13,30 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.659.153 €	8,51 €	208.349 £	9,31 £	7.630 \$	7,63 \$
31. Dezember 2021	–	–	–	–	9.897 \$	9,90 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.284 \$	8,28 \$	10.219 \$	8,34 \$	20.955.845 \$	8,70 \$
31. Dezember 2021	9.897 \$	9,90 \$	24.729.451 \$	9,90 \$	–	–

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD Z* NIW	Ausschüttende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	6.793.345 \$	9,42 \$

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF A* NIW	Thesaurierende Klasse CHF A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I2* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	11.340.526 CHF	10,96 CHF	–	–
31. Dezember 2021	–	–	27.116.186 CHF	12,78 CHF	–	–
31. Dezember 2020	245.969 CHF	12,18 CHF	26.614.564 CHF	13,02 CHF	591.109 CHF	11,82 CHF

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I4 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.061.234 CHF	8,89 CHF	–	–	630.955 €	9,94 €
31. Dezember 2021	9.745.025 CHF	10,33 CHF	–	–	2.490.523 €	11,64 €
31. Dezember 2020	13.638.640 CHF	10,49 CHF	881.986 CHF	12,07 CHF	4.639.370 €	11,94 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	525.213 €	11,42 €	–	–	236.709 €	9,75 €
31. Dezember 2021	636.746 €	13,27 €	–	–	364.406 €	11,29 €
31. Dezember 2020	665.054 €	13,49 €	379.170 €	9,36 €	849.293 €	11,45 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	533.388 €	9,51 €	383.031 €	6,66 €
31. Dezember 2021	–	–	690.833 €	11,23 €	530.868 €	8,30 €
31. Dezember 2020	91.115 €	12,53 €	851.019 €	11,60 €	890.783 €	8,99 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X NIW	Thesaurierende Klasse EUR X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	42.148.804 €	10,36 €	26.641 £	12,35 £	2.904.877 SEK	87,48 SEK
31. Dezember 2021	48.759.321 €	11,99 €	134.857 £	14,13 £	5.351.492 SEK	102,06 SEK
31. Dezember 2020	49.366.439 €	12,13 €	155.374 £	14,27 £	7.070.723 SEK	104,21 SEK

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	625.857 \$	7,32 \$	6.344.534 \$	12,24 \$	648.535 \$	9,32 \$
31. Dezember 2021	4.027.009 \$	8,81 \$	7.973.303 \$	14,03 \$	1.150.929 \$	10,80 \$
31. Dezember 2020	4.358.806 \$	9,41 \$	8.732.452 \$	14,25 \$	5.170.812 \$	11,08 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	20.881.275 \$	13,20 \$	2.641.379 \$	8,77 \$	775.368 \$	11,93 \$
31. Dezember 2021	23.231.127 \$	15,01 \$	3.211.502 \$	10,41 \$	1.015.839 \$	13,54 \$
31. Dezember 2020	19.781.489 \$	15,12 \$	3.358.805 \$	10,88 \$	1.288.435 \$	13,63 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	338.193 \$	12,32 \$	752.825 \$	9,38 \$	657.453 \$	7,19 \$
31. Dezember 2021	516.979 \$	13,95 \$	1.058.465 \$	10,83 \$	834.074 \$	8,76 \$
31. Dezember 2020	868.396 \$	14,01 \$	2.439.021 \$	11,10 \$	768.575 \$	9,40 \$

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	23.246.658 €	10,79 €	2.500.773 €	10,01 €	64.417.647 €	8,36 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I1* NIW	Thesaurierende Klasse USD I1* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.540 \$	8,54 \$	62.156.033 \$	8,55 \$

Systematic Global Sustainable Value

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	483.610 €	14,02 €	9.338 £	10,08 £	2.093.493 \$	15,83 \$
31. Dezember 2021	628.122 €	16,86 €	–	–	1.133.453 \$	18,26 \$
31. Dezember 2020	1.028.083 €	14,38 €	–	–	125.203 \$	15,29 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Systematic Global Sustainable Value (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.989.730 \$	16,71 \$	23.813.624 \$	9,47 \$	19.288.532 \$	18,15 \$
31. Dezember 2021	296.605 \$	19,19 \$	–	–	18.743.661 \$	20,75 \$
31. Dezember 2020	26.596 \$	15,99 \$	–	–	6.861.153 \$	17,19 \$

## Ultra Short Term Euro Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF P* NIW	Thesaurierende Klasse CHF P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF U NIW	Thesaurierende Klasse CHF U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	770.086 CHF	97,48 CHF	6.454.030 CHF	96,91 CHF	5.076.654 €	94,09 €
31. Dezember 2021	–	–	2.120.553 CHF	102,92 CHF	8.850.107 €	99,83 €
31. Dezember 2020	–	–	2.074.998 CHF	102,25 CHF	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	504.982.352 €	99,21 €	1.514.355 €	95,44 €	49.163.695 €	98,02 €
31. Dezember 2021	706.370.660 €	105,08 €	560.627 €	102,73 €	57.744.254 €	103,78 €
31. Dezember 2020	188.117.143 €	104,00 €	452.987 €	102,78 €	57.134.292 €	102,68 €



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR U NIW	Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil
31. Dezember 2022	163.327.491 €	99,56 €	75.202 €	93,22 €	3.981.734 €	97,51 €
31. Dezember 2021	233.134.238 €	105,34 €	25.116 €	99,50 €	6.150.837 €	103,38 €
31. Dezember 2020	147.478.945 €	104,17 €	–	–	384.498 €	102,42 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.239.437 €	100,17 €	2.354.804 \$	96,33 \$	–	–
31. Dezember 2021	63.252.625 €	105,86 €	4.003.742 \$	99,95 \$	–	–
31. Dezember 2020	282.469 €	104,59 €	–	–	31.060 \$	104,76 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	86.457.213 \$	107,40 \$
31. Dezember 2021	89.530.032 \$	111,22 \$
31. Dezember 2020	51.631.863 \$	109,03 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies

	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I5 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	3.430.851 CHF	10,34 CHF	1.500.147 CHF	10,74 CHF	32.208.149 €	10,07 €
31. Dezember 2021	5.076.587 CHF	9,72 CHF	472.414 CHF	10,05 CHF	53.757.935 €	9,52 €
31. Dezember 2020	3.621.121 CHF	9,88 CHF	478.745 CHF	10,19 CHF	18.773.059 €	9,73 €

	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	157.192.927 €	10,51 €	15.201.022 €	10,85 €	6.769.918 €	11,01 €
31. Dezember 2021	305.145.203 €	9,86 €	12.747.338 €	10,16 €	9.432.020 €	10,29 €
31. Dezember 2020	155.102.495 €	10,01 €	10.927.245 €	10,30 €	8.369.670 €	10,41 €

	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR P* NIW	Thesaurierende Klasse EUR P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil
<b>Geschäftsjahr zum</b>						
31. Dezember 2022	1.654.675 €	9,83 €	28.465.642 €	9,85 €	77.383.312 £	11,52 £
31. Dezember 2021	572.638 €	9,37 €	–	–	57.830.517 £	10,61 £
31. Dezember 2020	1.212.616 €	9,66 €	–	–	70.143.561 £	10,70 £

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	876.636.906 £	11,56 £	76.067 £	9,96 £	244.341.482 £	11,74 £
31. Dezember 2021	692.453.177 £	10,63 £	–	–	128.525.804 £	10,77 £
31. Dezember 2020	421.726.144 £	10,71 £	–	–	123.682.944 £	10,83 £

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	733.833.769 £	11,16 £	501.313 £	12,02 £	4.336.598.065 ¥	1.029,89 ¥
31. Dezember 2021	463.552.981 £	10,27 £	449.271 £	10,98 £	–	–
31. Dezember 2020	281.766.781 £	10,36 £	399.533 £	11,00 £	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	201.328 SGD	20,11 SGD	76.331.807 \$	11,03 \$	7.019.785 \$	10,57 \$
31. Dezember 2021	–	–	37.795.631 \$	10,26 \$	8.347.357 \$	9,92 \$
31. Dezember 2020	72.982 SGD	20,74 SGD	55.440.121 \$	10,41 \$	15.414.288 \$	10,17 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	253.706.005 \$	11,97 \$	59.598.401 \$	12,01 \$	23.473.722 \$	12,22 \$
31. Dezember 2021	160.413.816 \$	11,05 \$	70.576.833 \$	11,07 \$	17.185.423 \$	11,24 \$
31. Dezember 2020	96.977.902 \$	11,13 \$	57.656.240 \$	11,14 \$	16.190.315 \$	11,28 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	14.132.913 \$	10,89 \$	54.279.664 \$	11,66 \$	27.792.127 \$	12,32 \$
31. Dezember 2021	8.892.322 \$	10,21 \$	6.628.186 \$	10,76 \$	10.360.938 \$	11,28 \$
31. Dezember 2020	13.755.477 \$	10,44 \$	40.496.426 \$	10,83 \$	2.972.232 \$	11,28 \$

XXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	649.030.110 €	9,83 €	18.184.485 \$	10,00 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I3* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	2.722.761.830 ¥	816,04 ¥	3.127.165 \$	13,76 \$	3.063.327 \$	20,34 \$
31. Dezember 2021	–	–	1.156.841 \$	18,74 \$	1.524.356 \$	27,49 \$
31. Dezember 2020	–	–	871.353 \$	15,53 \$	517.631 \$	22,61 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.623.317 \$	20,18 \$	7.737 \$	7,74 \$
31. Dezember 2021	6.250.342 \$	27,28 \$	–	–
31. Dezember 2020	5.110.788 \$	22,44 \$	–	–

US Equity Index PutWrite

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	519.574 €	11,69 €	4.848.784 €	8,83 €	769.301 €	11,65 €
31. Dezember 2021	639.232 €	13,45 €	2.284.710 €	10,38 €	2.418.683 €	13,37 €
31. Dezember 2020	578.808 €	11,47 €	–	–	2.283.617 €	11,37 €

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I3* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	295.878 €	10,76 €	32.974.906 £	13,58 £	72.609.172 £	11,58 £
31. Dezember 2021	425.718 €	12,56 €	24.332.662 £	13,50 £	25.831.312 £	11,49 £
31. Dezember 2020	379.769 €	10,85 €	2.264.100 £	11,30 £	–	–

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I3* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	199.939.675 £	9,40 £	–	–	131.866.462 £	14,05 £
31. Dezember 2021	34.793.614 £	10,90 £	11.732 £	13,86 £	124.042.500 £	13,93 £
31. Dezember 2020	–	–	1.525.880 £	11,74 £	71.330.624 £	11,63 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	4.612.426 £	10,06 £	182.949 SGD	18,85 SGD
31. Dezember 2021	9.485 £	12,05 £	2.986.073 £	10,40 £	226.127 SGD	22,21 SGD
31. Dezember 2020	8.356 £	10,61 £	–	–	96.158 SGD	19,67 SGD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	12.416.490 \$	13,06 \$	–	–
31. Dezember 2021	–	–	13.407.217 \$	14,70 \$	–	–
31. Dezember 2020	49.997 \$	10,00 \$	10.464.313 \$	12,51 \$	163.028 \$	11,14 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	11.585.856 \$	10,55 \$	55.168.614 \$	13,71 \$	–	–
31. Dezember 2021	13.863.352 \$	12,29 \$	69.629.787 \$	15,34 \$	11.565 \$	13,62 \$
31. Dezember 2020	3.477.576 \$	10,81 \$	33.288.245 \$	12,96 \$	784.509 \$	11,50 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I3* NIW	Ausschüttende Klasse USD I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I4 NIW	Thesaurierende Klasse USD I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	18.562.430 \$	9,09 \$	5.127.891 \$	13,29 \$	1.208.956 \$	12,32 \$
31. Dezember 2021	10.941.666 \$	10,39 \$	27.897.131 \$	14,84 \$	1.500.582 \$	13,98 \$
31. Dezember 2020	–	–	32.287.784 \$	12,51 \$	995.139 \$	11,97 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD P* NIW	Thesaurierende Klasse USD P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	37.615.063 \$	13,87 \$
31. Dezember 2021	–	–	44.044.794 \$	15,43 \$
31. Dezember 2020	11.432 \$	11,47 \$	16.239.539 \$	12,95 \$

US Large Cap Value<sup>2</sup>

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	151.717 €	10,87 €	421.987 €	10,68 €	13.504.321 €	9,20 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	37.390.049 €	9,42 €	14.242.602 €	9,91 €	117.300.158 €	10,42 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	24.659 £	9,76 £	8.138 £	9,66 £	24.659 £	9,76 £



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup> (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.138 £	9,66 £	767.350.829 £	10,92 £	1.047.402 £	10,28 £
Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	28.455 £	10,63 £	79.855.605 £	10,48 £	57.641 £	10,29 £
Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I4* NIW	Ausschüttende Klasse USD I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	64.127.333 \$	9,50 \$	370.024.843 \$	10,28 \$	55.448.399 \$	9,63 \$
31. Dezember 2021	–	–	2.078.974 \$	10,39 \$	–	–
Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	51.156 \$	9,65 \$	47.864.951 \$	9,35 \$	13.571.781 \$	10,10 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	607.101 €	10,40 €	36.739.571 €	11,22 €	36.252.558 €	10,54 €
31. Dezember 2021	1.675.441 €	11,66 €	60.421.071 €	12,47 €	130.408.305 €	11,67 €
31. Dezember 2020	1.431.626 €	11,35 €	57.096.096 €	12,02 €	102.996.824 €	11,20 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	3.231.098 €	10,21 €	–	–
31. Dezember 2021	31.303 €	11,30 €	4.350.418 €	11,53 €	26.260 £	10,70 £
31. Dezember 2020	27.687 €	9,99 €	5.671.802 €	11,31 €	139.540 £	10,09 £

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW	Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW	Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	553.045 £	10,08 £	306.753 SGD	24,13 SGD	2.738.736 \$	11,72 \$
31. Dezember 2021	2.475.584 £	10,98 £	586.015 SGD	26,43 SGD	2.895.442 \$	12,74 \$
31. Dezember 2020	1.003.124 £	10,48 £	505.795 SGD	25,44 SGD	1.191.791 \$	12,34 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A1 NIW	Thesaurierende Klasse USD A1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil
31. Dezember 2022	15.008.727 \$	11,86 \$	13.820.694 \$	12,63 \$	–	–
31. Dezember 2021	19.263.231 \$	12,97 \$	17.243.832 \$	13,77 \$	–	–
31. Dezember 2020	9.583.362 \$	12,51 \$	15.175.857 \$	13,25 \$	46.340 \$	11,59 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I (PF) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (PF) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	32.577.472 \$	12,33 \$	49.565.162 \$	13,49 \$	13.048.932 \$	10,99 \$
31. Dezember 2021	37.308.429 \$	13,31 \$	30.548.534 \$	14,61 \$	123.743.798 \$	11,85 \$
31. Dezember 2020	36.974.960 \$	12,79 \$	27.237.243 \$	13,96 \$	83.893.777 \$	11,28 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD U NIW	Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.229.714 \$	10,98 \$	6.626.973 \$	12,39 \$	3.984.842 \$	14,90 \$
31. Dezember 2021	1.323.213 \$	12,11 \$	7.318.111 \$	13,49 \$	6.687.613 \$	15,93 \$
31. Dezember 2020	929.283 \$	11,77 \$	7.247.145 \$	12,95 \$	8.873.535 \$	15,02 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.517.141 AUD	16,18 AUD	1.676.142 AUD	15,19 AUD	1.895.752 €	22,53 €
31. Dezember 2021	2.111.989 AUD	20,43 AUD	2.011.793 AUD	18,99 AUD	2.356.991 €	28,01 €
31. Dezember 2020	801.623 AUD	16,78 AUD	542.124 AUD	15,44 AUD	2.734.679 €	22,52 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR1 A NIW	Thesaurierende Klasse EUR1 A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR1 I NIW	Thesaurierende Klasse EUR1 I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	493.074 €	15,91 €	1.953.365 €	25,08 €	3.440.135 €	27,36 €
31. Dezember 2021	691.776 €	20,22 €	2.709.496 €	31,56 €	5.287.010 €	34,13 €
31. Dezember 2020	741.251 €	16,62 €	1.593.328 €	25,68 €	11.712.117 €	27,54 €

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil
31. Dezember 2022	17.444 £	16,38 £	24.554.266 SGD	42,26 SGD	14.429.013 \$	17,80 \$
31. Dezember 2021	1.294.933 £	17,50 £	28.145.940 SGD	51,87 SGD	18.960.200 \$	21,90 \$
31. Dezember 2020	14.730 £	13,83 £	22.788.251 SGD	41,85 SGD	5.890.577 \$	17,83 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.855.172 \$	13,62 \$	775.262 \$	17,80 \$	12.157.572 \$	16,75 \$
31. Dezember 2021	2.930.473 \$	16,74 \$	1.349.591 \$	21,89 \$	14.699.492 \$	20,60 \$
31. Dezember 2020	2.554.201 \$	13,62 \$	1.928.675 \$	17,83 \$	4.041.172 \$	16,78 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	23.096.196 \$	26,14 \$	5.049.971 \$	23,44 \$	8.827.718 \$	18,95 \$
31. Dezember 2021	42.984.155 \$	31,41 \$	7.778.053 \$	28,22 \$	63.859.463 \$	23,28 \$
31. Dezember 2020	41.629.823 \$	25,00 \$	5.980.073 \$	22,49 \$	70.863.628 \$	18,94 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD P* NIW	Thesaurierende Klasse USD P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD U NIW	Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil
31. Dezember 2022	–	–	18.665.561 \$	19,51 \$	55.179.479 \$	26,82 \$
31. Dezember 2021	–	–	16.287.199 \$	23,75 \$	74.307.003 \$	32,48 \$
31. Dezember 2020	15.341 \$	13,15 \$	3.637.400 \$	19,15 \$	68.431.247 \$	26,05 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD1 A NIW	Thesaurierende Klasse USD1 A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD1 I NIW	Thesaurierende Klasse USD1 I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	285.453 \$	22,06 \$	68.130.989 \$	29,24 \$	188.629.207 \$	32,71 \$
31. Dezember 2021	309.426 \$	26,38 \$	92.720.656 \$	35,57 \$	386.342.131 \$	39,46 \$
31. Dezember 2020	99.951 \$	20,89 \$	87.666.797 \$	28,65 \$	267.245.719 \$	31,52 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD1 I NIW	Ausschüttende Klasse USD1 I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	5.497.999 \$	31,57 \$	44.251.345 ZAR	258,68 ZAR	714.961 ZAR	257,19 ZAR
31. Dezember 2021	9.701.682 \$	38,08 \$	45.494.408 ZAR	310,31 ZAR	2.184.221 ZAR	308,51 ZAR
31. Dezember 2020	5.395.001 \$	30,41 \$	41.744.051 ZAR	242,23 ZAR	4.142.138 ZAR	240,82 ZAR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2022	58.876.819 ZAR	238,22 ZAR	62.283.522 ZAR	283,17 ZAR
31. Dezember 2021	68.342.255 ZAR	285,76 ZAR	55.775.120 ZAR	336,29 ZAR
31. Dezember 2020	32.330.499 ZAR	223,06 ZAR	23.717.684 ZAR	259,90 ZAR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil
31. Dezember 2022	5.496.298 AUD	8,13 AUD	3.710.929 AUD	7,53 AUD	1.551.669 AUD	11,22 AUD
31. Dezember 2021	6.760.622 AUD	12,16 AUD	6.027.167 AUD	11,41 AUD	2.600.014 AUD	16,33 AUD
31. Dezember 2020	776.966 AUD	9,08 AUD	2.111.869 AUD	8,63 AUD	2.648.865 AUD	11,87 AUD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD C2* NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	13.633 AUD	7,54 AUD	–	–	1.845.753 AUD	7,52 AUD
31. Dezember 2021	105.874 AUD	11,42 AUD	80.242 AUD	17,34 AUD	2.585.873 AUD	11,40 AUD
31. Dezember 2020	148.081 AUD	8,65 AUD	152.006 AUD	12,61 AUD	1.357.371 AUD	8,62 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.473.276 AUD	12,14 AUD	4.048.009 AUD	8,74 AUD	5.292.429 AUD	14,37 AUD
31. Dezember 2021	2.325.484 AUD	17,67 AUD	4.853.764 AUD	13,11 AUD	7.209.536 AUD	20,70 AUD
31. Dezember 2020	1.180.760 AUD	12,85 AUD	2.480.739 AUD	9,82 AUD	2.870.444 AUD	14,90 AUD

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.863.576 CHF	13,32 CHF	1.065.458 €	7,98 €	9.711.898 €	17,63 €
31. Dezember 2021	2.817.702 CHF	19,35 CHF	2.596.896 €	11,56 €	55.428.758 €	25,33 €
31. Dezember 2020	1.931.175 CHF	13,97 CHF	1.091.201 €	8,31 €	11.488.469 €	18,10 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	525.424 €	10,78 €	63.131.693 HKD	8,82 HKD	798.510 SGD	27,99 SGD
31. Dezember 2021	438.137 €	15,75 €	99.874.888 HKD	12,92 HKD	1.651.444 SGD	39,53 SGD
31. Dezember 2020	60.942 €	11,46 €	18.318.949 HKD	9,60 HKD	145.367 SGD	28,23 SGD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	34.765.827 \$	10,15 \$	219.433.044 \$	21,92 \$	14.624.460 \$	15,81 \$
31. Dezember 2021	62.774.093 \$	14,78 \$	326.167.994 \$	30,68 \$	22.321.099 \$	22,25 \$
31. Dezember 2020	11.941.179 \$	10,97 \$	110.760.996 \$	21,88 \$	4.089.319 \$	16,21 \$



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2022	21.360.783 \$	8,45 \$	17.275.041 \$	13,48 \$	13.832.889 \$	11,25 \$
31. Dezember 2021	33.168.750 \$	12,47 \$	29.310.925 \$	19,11 \$	28.282.999 \$	15,90 \$
31. Dezember 2020	14.331.779 \$	9,38 \$	9.727.594 \$	13,81 \$	19.164.005 \$	11,45 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	285.279 \$	8,56 \$	345.981 \$	13,47 \$	9.804.365 \$	8,45 \$
31. Dezember 2021	749.291 \$	12,63 \$	688.744 \$	19,10 \$	15.300.421 \$	12,47 \$
31. Dezember 2020	731.875 \$	9,49 \$	1.191.845 \$	13,80 \$	8.260.059 \$	9,38 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2022	11.862.421 \$	12,79 \$	202.117 \$	8,69 \$	136.972.776 \$	24,75 \$
31. Dezember 2021	24.475.060 \$	18,13 \$	344.192 \$	12,56 \$	195.054.656 \$	34,38 \$
31. Dezember 2020	11.436.978 \$	13,10 \$	58.740 \$	9,25 \$	76.828.613 \$	24,33 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	8.086.151 \$	14,51 \$	16.291.811 \$	18,19 \$	47.619.174 \$	13,12 \$
31. Dezember 2021	10.560.006 \$	20,43 \$	2.122.857 \$	25,22 \$	77.016.676 \$	18,55 \$
31. Dezember 2020	1.013.087 \$	14,88 \$	799.855 \$	17,82 \$	19.654.163 \$	13,36 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	12.964.064 \$	9,72 \$	17.827.622 \$	14,79 \$	2.792.788 \$	14,36 \$
31. Dezember 2021	19.323.514 \$	14,20 \$	27.328.508 \$	20,76 \$	8.756.783 \$	19,79 \$
31. Dezember 2020	3.781.460 \$	10,57 \$	8.086.551 \$	14,85 \$	6.039.928 \$	13,91 \$

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	95.145.043 ZAR	78,11 ZAR	32.016.598 ZAR	162,51 ZAR	2.020.359 ZAR	77,23 ZAR
31. Dezember 2021	138.032.992 ZAR	117,12 ZAR	47.169.493 ZAR	224,68 ZAR	6.006.511 ZAR	115,79 ZAR
31. Dezember 2020	55.308.351 ZAR	88,45 ZAR	39.094.929 ZAR	155,84 ZAR	4.971.060 ZAR	87,45 ZAR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil
31. Dezember 2022	955.698 ZAR	160,47 ZAR	50.137.837 ZAR	78,12 ZAR	28.025.473 ZAR	181,81 ZAR
31. Dezember 2021	1.359.201 ZAR	221,86 ZAR	84.148.761 ZAR	117,13 ZAR	31.306.257 ZAR	251,37 ZAR
31. Dezember 2020	1.039.676 ZAR	153,87 ZAR	21.990.098 ZAR	88,45 ZAR	18.757.264 ZAR	174,35 ZAR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2022	103.488.803 ZAR	120,20 ZAR	47.847.359 ZAR	223,40 ZAR
31. Dezember 2021	142.721.631 ZAR	178,43 ZAR	48.481.475 ZAR	305,79 ZAR
31. Dezember 2020	50.784.596 ZAR	133,39 ZAR	19.615.302 ZAR	209,98 ZAR

US Small Cap

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.174.595 AUD	10,86 AUD	17.906 AUD	10,59 AUD	1.486.516 AUD	15,20 AUD
31. Dezember 2021	1.981.465 AUD	14,09 AUD	16.019 AUD	13,74 AUD	2.328.434 AUD	19,71 AUD
31. Dezember 2020	885.264 AUD	12,31 AUD	59.835 AUD	12,01 AUD	1.214.209 AUD	17,23 AUD

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	1.570.235 AUD	14,04 AUD	2.265.778 €	15,29 €	368.888 €	12,63 €
31. Dezember 2021	1.820.027 AUD	18,03 AUD	3.484.945 €	19,76 €	258.498 €	14,80 €
31. Dezember 2020	634.012 AUD	15,61 AUD	504.436 €	17,11 €	29.818 €	11,78 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.429.996 €	18,08 €	3.457.660 €	16,36 €	22.369.014 €	15,26 €
31. Dezember 2021	15.210.300 €	23,17 €	5.166.629 €	19,01 €	22.971.126 €	17,70 €
31. Dezember 2020	3.108.023 €	19,88 €	727.084 €	15,00 €	16.369.196 €	13,95 €

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	38.159.092 €	9,86 €	213.152 €	15,49 €	323.177 €	17,10 €
31. Dezember 2021	–	–	196.729 €	20,22 €	405.073 €	21,73 €
31. Dezember 2020	–	–	90.346 €	17,68 €	191.246 €	18,49 €

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	4.342.939.609 ¥	4,82 ¥	96.318.017 \$	24,40 \$	10.366.064 \$	15,75 \$
31. Dezember 2021	5.847.817.173 ¥	5,21 ¥	190.419.002 \$	30,47 \$	14.304.320 \$	19,67 \$
31. Dezember 2020	3.866.535.201 ¥	3,96 ¥	94.334.706 \$	26,10 \$	5.159.376 \$	16,85 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E	Thesaurierende Klasse USD E
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	7.251.318 \$	18,10 \$	61.322 \$	18,12 \$	2.587.858 \$	15,96 \$
31. Dezember 2021	10.526.062 \$	22,86 \$	181.210 \$	22,89 \$	7.216.838 \$	20,15 \$
31. Dezember 2020	9.497.339 \$	19,79 \$	452.710 \$	19,82 \$	3.538.633 \$	17,45 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD I3
	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil	NIW	NIW je Anteil
31. Dezember 2022	225.900.152 \$	27,02 \$	21.992.051 \$	19,66 \$	101.463.016 \$	13.534,58 \$
31. Dezember 2021	263.869.062 \$	33,46 \$	36.174.960 \$	24,35 \$	84.251.233 \$	16.717,30 \$
31. Dezember 2020	204.818.639 \$	28,41 \$	13.968.767 \$	20,67 \$	111.832.238 \$	14.159,56 \$

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2022	3.240.409 \$	18,23 \$	7.242.861 \$	19,89 \$	2.213.208 \$	18,32 \$
31. Dezember 2021	90.250.100 \$	22,98 \$	8.388.800 \$	24,87 \$	3.275.208 \$	22,49 \$
31. Dezember 2020	72.307.070 \$	19,88 \$	5.109.551 \$	21,32 \$	174.277 \$	18,93 \$

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2022	18.435.416 ZAR	226,59 ZAR	18.202.064 ZAR	189,12 ZAR
31. Dezember 2021	21.140.644 ZAR	279,01 ZAR	30.686.645 ZAR	230,55 ZAR
31. Dezember 2020	21.374.260 ZAR	231,92 ZAR	18.594.309 ZAR	189,73 ZAR

## US Small Cap Intrinsic Value

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2022	42.248.255 £	10,04 £	13.137.811 £	9,31 £	8.698.122 \$	19,11 \$
31. Dezember 2021	22.099.755 £	11,24 £	9.171.753 £	10,40 £	9.101.564 \$	24,28 \$
31. Dezember 2020	–	–	–	–	2.078.429 \$	19,38 \$

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2022	85.094.541 \$	16,80 \$	32.935.389 \$	8,44 \$	500.654 \$	15,88 \$
31. Dezember 2021	101.565.129 \$	21,17 \$	–	–	579.481 \$	20,38 \$
31. Dezember 2020	94.722.218 \$	16,76 \$	–	–	11.958 \$	16,43 \$

\* Die Anteil Klasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Bei den angegebenen Beträgen zum Nettoinventarwert und Nettoinventarwert je Anteil handelt es sich um Werte für den Handel mit Anteilhabern.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 14. WECHSELKURSE

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2022) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

US\$ 1 = AED 3,67265	US\$ 1 = CZK 22,63200	US\$ 1 = ILS 3,52850	US\$ 1 = PEN 3,81350	US\$ 1 = THB 34,63500
US\$ 1 = ARS 324,90000	US\$ 1 = DKK 6,96785	US\$ 1 = INR 82,73000	US\$ 1 = PHP 55,72750	US\$ 1 = TRY 18,71950
US\$ 1 = AUD 1,47460	US\$ 1 = DOP 56,22000	US\$ 1 = JPY 131,94500	US\$ 1 = PLN 4,38625	US\$ 1 = TWD 30,73550
US\$ 1 = BRL 5,27975	US\$ 1 = EGP 24,75500	US\$ 1 = KES 123,40000	US\$ 1 = QAR 3,64175	US\$ 1 = UGX 3.720,00000
US\$ 1 = CAD 1,35495	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = KRW 1.264,50000	US\$ 1 = RON 4,63605	US\$ 1 = UYU 39,76500
US\$ 1 = CHF 0,92520	US\$ 1 = GBP 0,83132	US\$ 1 = MXN 19,48725	US\$ 1 = RSD 109,92500	US\$ 1 = VND 23.575,00000
US\$ 1 = CLP 851,95000	US\$ 1 = GHS 10,20000	US\$ 1 = MYR 4,40500	US\$ 1 = RUB 73,00000	US\$ 1 = ZAR 17,01500
US\$ 1 = CNH 6,91885	US\$ 1 = HKD 7,80495	US\$ 1 = NGN 460,75000	US\$ 1 = SAR 3,75800	US\$ 1 = ZMW 18,07500
US\$ 1 = CNY 6,95170	US\$ 1 = HUF 375,21670	US\$ 1 = NOK 9,85100	US\$ 1 = SEK 10,41950	
US\$ 1 = COP 4.848,88500	US\$ 1 = IDR 15.567,50000	US\$ 1 = NZD 1,58115	US\$ 1 = SGD 1,34120	
€ 1 = AUD 1,57377	€ 1 = DKK 7,43644	€ 1 = JPY 140,81830	€ 1 = PLN 4,68123	€ 1 = SGD 1,43140
€ 1 = CAD 1,44607	€ 1 = GBP 0,88723	€ 1 = NOK 10,51348	€ 1 = SEK 11,12021	€ 1 = USD 1,06725
€ 1 = CHF 0,98742	€ 1 = HKD 8,32983			
CNH 1 = CNY 1,00000	CNH 1 = GBP 0,12015	CNH 1 = SGD 0,19385		
CNH 1 = EUR 0,13543	CNH 1 = HKD 1,12807	CNH 1 = USD 0,14453		
1 ¥ = USD 0,00758				

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2021) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

US\$ 1 = ARS 201,22000	US\$ 1 = DKK 6,54025	US\$ 1 = INR 74,33565	US\$ 1 = PEN 3,99075	US\$ 1 = TRY 13,27975
US\$ 1 = AUD 1,37542	US\$ 1 = DOP 57,26000	US\$ 1 = JPY 115,15500	US\$ 1 = PHP 50,99250	US\$ 1 = TWD 27,66700
US\$ 1 = BRL 5,57000	US\$ 1 = EGP 15,71000	US\$ 1 = KES 113,15000	US\$ 1 = PLN 4,03040	US\$ 1 = UAH k. A.
US\$ 1 = CAD 1,26315	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = KRW 1.188,75000	US\$ 1 = RON 4,35170	US\$ 1 = UGX 3.545,00000
US\$ 1 = CHF 0,91115	US\$ 1 = GBP 0,73831	US\$ 1 = KZT 434,80500	US\$ 1 = RSD 103,39000	US\$ 1 = UYU 44,70000
US\$ 1 = CLP 852,00000	US\$ 1 = GHS 6,17500	US\$ 1 = MXN 20,46500	US\$ 1 = RUB 75,00625	US\$ 1 = ZAR 15,96000
US\$ 1 = CNH 6,35905	US\$ 1 = HKD 7,79630	US\$ 1 = MYR 4,16600	US\$ 1 = SAR 3,75440	US\$ 1 = ZMW 16,66810
US\$ 1 = CNY 6,37335	US\$ 1 = HUF 324,09870	US\$ 1 = NGN 413,75000	US\$ 1 = SEK 9,05385	
US\$ 1 = COP 4.070,00000	US\$ 1 = IDR 14.252,50000	US\$ 1 = NOK 8,81830	US\$ 1 = SGD 1,34815	
US\$ 1 = CZK 21,85190	US\$ 1 = ILS 3,11240	US\$ 1 = NZD 1,46060	US\$ 1 = THB 33,40500	
€ 1 = AUD 1,56413	€ 1 = DKK 7,43757	€ 1 = HKD 8,86595	€ 1 = PLN 4,58337	€ 1 = SGD 1,53312
€ 1 = CHF 1,03616	€ 1 = GBP 0,83960	€ 1 = NOK 10,02817	€ 1 = SEK 10,29604	€ 1 = USD 1,13720
CNY 1 = EUR 0,13828	CNY 1 = HKD 1,22602	CNY 1 = USD 0,15726		
CNY 1 = GBP 0,11610	CNY 1 = SGD 0,21200			



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

14. WECHSELKURSE (FORTSETZUNG)

AED	VAE-Dirham	IDR	Indonesische Rupiah	SAR	Saudi-Riyal
ARS	Argentinischer Peso	ILS	Israelischer Schekel	SEK	Schwedische Krone
AUD	Australischer Dollar	INR	Indische Rupie	SGD	Singapur-Dollar
BRL	Brasilianischer Real	JPY	Japanischer Yen (¥)	THB	Thailändischer Baht
CAD	Kanadischer Dollar	KES	Kenianischer Schilling	TRY	Türkische Lira
CHF	Schweizer Franken	KRW	Südkoreanischer Won	TWD	Neuer taiwanesischer Dollar
CLP	Chilenischer Peso	KZT	Kasachischer Tenge	UAH	Ukrainischen Hrywnia
*CNH	Chinesischer Yuan Renminbi	MXN	Mexikanischer Peso	UGX	Uganda-Schilling
*CNY	Chinesischer Yuan Renminbi	MYR	Malaysischer Ringgit	USD	US-Dollar (\$)
COP	Kolumbianischer Peso	NGN	Nigerianischer Naira	UYU	Uruguayischer Peso
CZK	Tschechische Krone	NOK	Norwegische Krone	VND	Vietnamesischer Dong
DKK	Dänische Krone	NZD	Neuseeländischer Dollar	ZAR	Südafrikanischer Rand
DOP	Dominikanischer Peso	PEN	Peruanischer Sol	ZMW	Sambischer Kwacha
EGP	Ägyptisches Pfund	PHP	Philippinischer Peso		
EUR	Euro (€)	PLN	Polnischer Zloty		
GBP	Britisches Pfund (£)	QAR	Katar-Rial		
GHS	Ghanaischer Cedi	RON	Rumänischer neuer Leu		
HKD	Hongkong-Dollar	RSD	Serbischer Dinar		
HUF	Ungarischer Forint	RUB	Russischer Rubel		

\*Es gibt in China eine offizielle Währung, den chinesischen Yuan Renminbi. Der CNY wird „onshore“, auf dem chinesischen Festland, gehandelt, der CNH „offshore“, in erster Linie in Hongkong, zu jeweils unterschiedlichen Wechselkursen.

15. BERICHTIGUNG DER WÄHRUNGSUMRECHNUNG

Der Konzernabschluss für den Fonds ist auf US-Dollar denominiert. Zum Zwecke der Berichterstattung der Gesamtergebnisse des Fonds wurden die Ergebnisse einiger Portfolios zu den nachstehend angegebenen Kursen in US-Dollar umgerechnet.

Portfolio	Bilanz		Gewinn- und Verlustrechnung und die Aufstellung über die Entwicklung der auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	
	Schlusskurs		Durchschnittskurs	
	31.Dezember 2022	31.Dezember 2021	31.Dezember 2022	31.Dezember 2021
China A-Share Equity	US\$ 1 = CNY 6,95170	US\$ 1 = CNY 6,37335	US\$ 1 = CNY 6,72665	US\$ 1 = CNY 6,45036
China Bond	US\$ 1 = CNY 6,95170	US\$ 1 = CNY 6,37335	US\$ 1 = CNY 6,72665	US\$ 1 = CNY 6,45036
Corporate Hybrid Bond	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = EUR 0,94726	US\$ 1 = EUR 0,84567
Euro Bond Absolute Return	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = EUR 0,94726	US\$ 1 = EUR 0,84567
Euro Opportunistic Bond	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = EUR 0,94726	US\$ 1 = EUR 0,84567
European High Yield Bond	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = EUR 0,94726	US\$ 1 = EUR 0,84567
European Sustainable Equity	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = EUR 0,94726	US\$ 1 = EUR 0,84947
Japan Equity Engagement	US\$ 1 = JPY 131,9450	US\$ 1 = JPY 115,1550	US\$ 1 = JPY 130,6254	US\$ 1 = JPY 109,7940
Macro Opportunities FX	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = EUR 0,94726	US\$ 1 = EUR 0,84567
Ultra Short Term Euro Bond	US\$ 1 = EUR 0,93699	US\$ 1 = EUR 0,87935	US\$ 1 = EUR 0,94726	US\$ 1 = EUR 0,84567

Aus der Umrechnung des Eröffnungnettovermögens, der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens ergab sich eine nominale Währungsanpassung von (304.151.197) US\$ (31. Dezember 2021: (271.028.314) US\$). Die Umrechnungsmethode hat keinen Einfluss auf den Wert des Nettovermögens, der den einzelnen Portfolios zuzuschreiben ist.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****16. VEREINBARUNGEN ÜBER PROVISIONSNACHLÄSSE (SOFT COMMISSIONS)**

Der Manager und verbundene Personen haben in begrenzten Fällen Vereinbarungen über Provisionsnachlässe mit Brokern in Bezug auf Research-Produkte abgeschlossen unter der Voraussetzung, dass sie die beste Ausführung (Best Execution) zur Unterstützung von Anlagenentscheidungen erhalten.

Zu den erhaltenen Research-Leistungen gehören alle standardmäßigen Research-Produkte, insbesondere aktuelle und historische Daten in Bezug auf bestimmte Unternehmen, Branchen und die Finanzwirtschaft insgesamt sowie Informationen über Chancen, Risiken und Trends sowie Analysen in Bezug auf spezielle Situationen. Der Manager ist der Auffassung, dass diese Vereinbarungen den Portfolios zugute kommen, und hat sich davon überzeugt, dass er für die Portfolios die beste Ausführung erhält.

**17. GETRENNTE HAFTUNG**

Der Fonds hat mehrere Portfolios und weitere Portfolios können künftig aufgelegt werden. Mit der Zustimmung der Anteilhaber des Fonds, die am 3. November 2006 durch einen Sonderbeschluss erteilt wurde, hat der Fonds die getrennte Haftung zwischen seinen Portfolios eingeführt. Ab diesem Datum trägt jedes Portfolio seine eigenen Verbindlichkeiten, und weder der Fonds noch die vom Fonds ernannten Dienstleistungsanbieter noch die Direktoren, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch eine sonstige Person erhalten Zugriff auf die Vermögenswerte eines Portfolios zur Begleichung von Verbindlichkeiten eines anderen Portfolios.

**18. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT**

Der Fonds kann zu den Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von der Zentralbank vorgegeben werden, in Bezug auf Wertpapiere und/oder Finanzinstrumente, einschließlich derivative Instrumente, Anlagetechniken und Instrumente anwenden, vorausgesetzt, dass diese für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements (d. h. zur Absicherung, zur Reduzierung von Risiken oder Kosten oder zur Steigerung der Kapital- oder Ertragsrendite) oder für Anlagezwecke angewandt werden. Die angewandten Techniken und Instrumente dürfen nur in Einklang mit den Anlagezielen des jeweiligen Portfolios eingesetzt werden.

Nach Ermessen des Managers und des Sub-Investment-Managers kann jedes Portfolio zu den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen für alle Arten von Vermögenswerten, in die das Portfolio anlegen kann, Wertpapierleihgeschäfte („Wertpapierleihverträge“) abschließen, so wie im Abschnitt „Instrumente/Anlageklassen“ im jeweiligen Zusatz für das Portfolio beschrieben. Solche Wertpapierleihgeschäfte können zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden.

Wertpapierleihverträge sind Transaktionen, über die ein Portfolio seine Wertpapiere an eine andere Partei, den Kreditnehmer, ausleiht, der vertraglich verpflichtet ist, zum Ende eines vereinbarten Zeitraums äquivalente Wertpapiere zurückzugeben. Solange die Wertpapiere ausgeliehen sind, zahlt der Kreditnehmer dem Portfolio (i) eine Kreditgebühr und (ii) Erträge aus den Wertpapieren.

Der Fonds erhielt für jedes Portfolio, das Wertpapierleihverträge abschloss, Sicherheiten in Höhe von mindestens 102 % des Werts der ausgeliehenen Wertpapiere. Portfolios können nur Wertpapierleihgeschäfte abschließen, im Rahmen derer (i) sie berechtigt sind, zu jeder Zeit die Rückgabe der verliehenen Wertpapiere zu beantragen oder die Wertpapierleihgeschäfte zu kündigen und (ii) die Transaktionen die Verwaltung der Vermögenswerte des Portfolios im Einklang mit seiner Anlagepolitik nicht gefährden. Sofern nicht anderweitig in dem entsprechenden Zusatz festgelegt, beträgt der maximale Anteil eines Nettoinventarwerts eines Portfolios, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden können, 50 % und der erwartete Anteil eines Nettoinventarwerts, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden, beträgt 0-10 %.

Der Fonds hat Brown Brothers Harriman & Co. (der „Lending Agent“) damit beauftragt, die Wertpapierleihverträge auszuführen, darunter, vorbehaltlich der vorherigen Zustimmung durch den Fonds, die Auswahl der Gegenparteien und die Verwaltung der Sicherheit. Portfolios, die Wertpapierleihverträge eingingen, erhielten das gesamte Einkommen aus diesen Wertpapierleihverträgen, abzüglich direkter und indirekter Betriebskosten, das 90 % des insgesamt generierten Einkommens ausmachte. Die übrigen 10 % wurden an den Lending Agent als Gegenleistung für die direkten und indirekten Betriebskosten für die Erbringung seiner Dienstleistungen und die Bereitstellung seiner Garantie gezahlt. Die Gesellschaft stieg im Juli aus dem Wertpapierleihprogramm aus, die von den Portfolios in den entsprechenden Zeitraum aus der Wertpapierleihe verdienten Erträge werden separat in der Gewinn- und Verlustrechnung aufgeführt.

Zum 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**18. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2021 betrug der Wert der ausgeliehenen Wertpapiere und der Wert der Sicherheit in Form von vom Portfolio verbuchten Wertpapieren:

Portfolio	Währung	Wert der ausgeliehenen Wertpapiere	Wert der Sicherheit	% der gehaltenen Sicherheit
Corporate Hybrid Bond	EUR	8.635.753	9.069.372	105 %
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	1.369.293	1.437.806	105 %
Emerging Markets Equity	USD	917.277	963.656	105 %
Emerging Markets Select Equity	USD	1.014.757	1.066.211	105 %
Euro Bond Absolute Return	EUR	295.609	310.400	105 %
European High Yield Bond	EUR	734.967	771.750	105 %
Global High Yield SDG Engagement	USD	150.480	158.013	105 %
High Yield Bond	USD	74.575.394	78.314.591	105 %
Short Duration Emerging Market Debt	USD	511.815	537.514	105 %
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	3.553.505	3.731.603	105 %
Strategic Income	USD	12.819.976	13.464.004	105 %
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	10.227.006	10.739.879	105 %
US Long Short Equity	USD	6.672.007	7.007.541	105 %

Im zum 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahr haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt - Hard Currency, der Emerging Market Debt Blend, der High Yield Bond und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 bei 140.059 US\$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 bei 6.300 US\$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomangementtechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 hat der Fonds keine Pensionsgeschäfte abgeschlossen.

**19. KREDITFAZILITÄT**

Bei der Sitzung der Direktoren vom 20. Juni 2016 wurde mit The Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd. vereinbart, dass sie zusammen mit einem Syndikat von anderen Banken (zusammen die „Kreditgeber“) dem Fonds in Bezug auf die Portfolios ab dem Datum der Ausfertigung eines Kreditvertrags mit der Bank eine zugesagte Liquiditätsfazilität bis zu einem Höchstbetrag von 500.000.000 US\$ (die „Fazilität“) zur Verfügung stellt, und dass der Gegenwert der Fazilität nur für den vorübergehenden Liquiditätsbedarf oder in Notlagen in Anspruch genommen werden darf. Ab 4. Oktober 2018 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 500.000.000 US\$ auf 600.000.000 US\$ erhöht. Am 27. März 2020 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 600.000.000 US\$ auf 975.000.000 US\$ erhöht. Am 1. Oktober 2020 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 975.000.000 US\$ auf 750.000.000 US\$ reduziert. Am 30. September 2021 wurde der maximale Betrag der zugesagten Liquiditätsfazilität von 750.000.000 US\$ auf 850.000.000 US\$ erhöht. Die Fazilität in Höhe von 850.000.000 US\$ wurde am 29. September 2022 für den Zeitraum von 364 Tagen für sämtliche Portfolios verlängert. Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 nahm Event Driven nicht an der Fazilität teil. Die Kosten für die Bereitstellungsprovision wurden dementsprechend geändert.

Zum 31. Dezember 2022 gab es keine im Rahmen der Fazilität ausstehenden Kredite (31. Dezember 2021: ebenso). In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 wurde die Kreditfazilität von keinem der Portfolios in Anspruch genommen

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****20. UNGEDECKTE KREDITZUSAGEN**

Zum 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine ungedeckten Kreditverbindlichkeiten:

Zum 31. Dezember 2021 hatte der Fonds die folgenden ungedeckten Kreditverbindlichkeiten:

Name des Portfolios	Name des Wertpapiers	Nicht finanzierte Zusagen USD	Zeitwert USD
High Yield Bond	Service Logic Acquisition Inc	503.393	507.842
Short Duration High Yield SDG Engagement	Service Logic Acquisition Inc	131.500	132.662
Strategic Income	Intelsat Jackson Holdings S.A.	49.485	50.078
Strategic Income	Pro Mach Group Inc	55.031	55.568

**21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES**

Die Invasion der Ukraine durch Russland und die damit zusammenhängenden Ereignisse Ende Februar 2022 haben nachteilige Auswirkungen auf Rohstoffe und die europäische Konjunktur gehabt und dies könnte weiterhin der Fall sein. Das direkte Engagement des Fonds in Russland und der Ukraine ist begrenzt, die Geschäftsleitung wird aber weiterhin potenzielle Auswirkungen auf die Aktivitäten des Fonds überwachen, insbesondere die erhobenen russischen Sanktionen und der Anstieg bei den damit verbundenen makroökonomischen und geopolitischen Risiken.

Um die Qualität und Effektivität der von den amtierenden Abschlussprüfern erbrachten Leistungen mit denen anderer Wirtschaftsprüfungsgesellschaften zu vergleichen, führte der Fonds 2021 ein Ausschreibungsverfahren für die Bestellung seines externen Abschlussprüfers durch. Die Ausschreibung der Abschlussprüfung wurde 2022 abgeschlossen und resultierte in der Wiederbestellung von Ernst & Young zum externen Abschlussprüfer des Fonds.

Die wirtschaftlichen Unsicherheiten und Unsicherheiten am Finanzmarkt blieben angetrieben durch die anhaltend höhere Inflation und die Straffung der Geldpolitik weiter erhöht, da die Zentralbanken die Basiszinssätze erhöht und die Kreditbedingungen verschärft haben, was jüngste Ereignisse im Bankensektor zeigen. Diese Marktbedingungen tragen zu einer zusätzlichen Volatilität und Fluktuation bei den Marktvariablen bei, einschließlich unter anderem den Zinsen, Wechselkursen, Aktienkursen, Rohstoffpreisen, einer Erhöhung der Kreditspreads, implizierter Volatilitäten und Asset-Korrelationen. Das Management überwacht die Ereignisse und jegliche Engagements in Sektoren mit erhöhtem Risiko aktiv.

Der Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.

Der Neuberger Berman Commodities Fund wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Mit Wirkung zum 6. April 2022 wurde der Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund in Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund umbenannt.

Am 6. April 2022 wurden von der Zentralbank ein neuer Prospekt und Nachträge zum Prospekt vermerkt.

Der Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

Der XXXXXXXXXXXX wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Mit Wirkung zum Freitag, 19. August 2022 wurde der Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund in Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum Montag, 3. Oktober 2022 wurde der Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund in Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund umbenannt.

Der Neuberger Berman Event Driven Fund wurde am Mittwoch, 26. Oktober 2022 aufgelegt.

Am 28. November 2022 wurden von der Zentralbank ein neuer Prospekt und Nachträge zum Prospekt vermerkt., die die Umbenennung des Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund in Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund, Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund in Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund und Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund in Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund abdeckt.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)**

**Während des Jahres änderten die unten aufgeführten Portfolios ihre SFDR-Klassifizierungen wie folgt:**

a) Portfolios, die von Artikel 9 in Artikel 8 umklassifiziert wurden:

- Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund
- Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund
- Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund
- Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund

b) Portfolios, die von Artikel 8 in Artikel 6 umklassifiziert wurden:

- Neuberger Berman CLO Income Fund

Außer den oben erwähnten sind während des Geschäftsjahres keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

**22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES**

Ein neuer Multi-Strategy-Nachtrag zum Prospekt, der die Änderung der Berechnungsmethode der erfolgsabhängigen Gebühr für den Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund abdeckt, wurde von der Zentralbank am 3. Januar 2023 vermerkt.

Der XXXXXXXXXXXX soll nach dem 1. Quartal 2023 aufgelöst werden.

Die wirtschaftlichen Unsicherheiten und Unsicherheiten am Finanzmarkt blieben angetrieben durch die anhaltend höhere Inflation und die Straffung der Geldpolitik weiter erhöht, da die Zentralbanken die Basiszinssätze erhöht und die Kreditbedingungen verschärft haben, was jüngste Ereignisse im Bankensektor zeigen. Diese Marktbedingungen tragen zu einer zusätzlichen Volatilität und Fluktuation bei den Marktvariablen bei, einschließlich unter anderem den Zinsen, Wechselkursen, Aktienkursen, Rohstoffpreisen, einer Erhöhung der Kreditspreads, implizierter Volatilitäten und Asset-Korrelationen. Das Management überwacht die Ereignisse und jegliche Engagements in Sektoren mit erhöhtem Risiko aktiv.

Im Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis einschließlich 19. April 2023 gab es Zeichnungen und Rücknahmen in erheblichem Umfang, die in nachstehender Tabelle aufgeführt sind:

Portfolio	Währung	Zeichnungen	Rücknahmen
5G Connectivity	USD	-	107.432.776
Asian Debt - Hard Currency	USD	10.095.851	10.261.222
CLO Income	USD	-	14.395.148
Commodities	USD	10.706.519	-
Corporate Hybrid Bond	EUR	148.395.797	174.271.136
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	235.867.432	270.730.097
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	-	280.920.066
Emerging Market Debt Blend	USD	-	26.543.624
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	4.554.359	-
Emerging Markets Equity	USD	59.117.961	88.624.179
Euro Bond Absolute Return	EUR	14.067.375	15.293.381
European High Yield Bond	EUR	30.025.522	16.271.903
European Sustainable Equity	EUR	20.446.096	43.486.094
Event Driven	USD	21.415.092	10.490.148
Global Equity Megatrends	USD	12.625.720	5.420.613
Global Flexible Credit Income	USD	-	78.121.782

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)

Portfolio	Währung	Zeichnungen	Rücknahmen
Global High Yield SDG Engagement	USD	225.945.230	-
Global Opportunistic Bond	USD	-	11.988.215
Global Real Estate Securities	USD	-	3.853.531
Global Sustainable Equity	USD	8.766.222	-
High Yield Bond	USD	235.077.877	279.270.335
InnovAsia 5G	USD	2.236.033	-
Japan Equity Engagement	JPY	-	1.199.534.422
Macro Opportunities FX	EUR	2.762.294	2.299.210
Multi-Asset Income	USD	-	1.312.857
Next Generation Mobility	USD	-	8.961.311
Next Generation Space Economy	USD	1.509.325	-
Short Duration Emerging Market Debt	USD	303.977.189	470.023.127
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	170.366.860	98.604.270
Strategic Income	USD	192.715.629	117.778.582
Sustainable Asia High Yield	USD	-	2.178.195
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	-	6.142.707
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	9.369.695	-
Systematic Global Sustainable Value	USD	-	4.018.433
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	116.713.986	134.075.273
Uncorrelated Strategies	USD	298.209.954	306.171.171
US Equity Index PutWrite	USD	47.169.442	125.360.104
US Large Cap Value	USD	336.374.147	198.785.939
US Long Short Equity	USD	17.188.567	21.731.716
US Multi Cap Opportunities	USD	33.298.032	60.507.477
US Real Estate Securities	USD	-	67.832.208
US Small Cap	USD	49.379.199	-
US Small Cap Intrinsic Value	USD	56.501.158	-

Außer den oben erwähnten sind seit Jahresende keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

## 23. SONSTIGE SACHVERHALTE

Seit dem Ende des Geschäftsjahres oder währendes des Jahres hat es keine wesentlichen anderen, den Fonds betreffenden Ereignisse gegeben.

## 24. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Die Direktoren haben den Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss am 19. April 2023 genehmigt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Investment Advisers LLC, einem bei der Securities Exchange Commission („SEC“) in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA („US GAAP“) entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

5G Connectivity

	Thesaurierende Klasse AUD A AUD	Thesaurierende Klasse CNY A RMB	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,75	101,38	15,39	15,55	14,16	14,87
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,14)	(1,01)	(0,15)	(0,15)	(0,05)	(0,06)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(6,63)	(43,36)	(6,92)	(6,06)	(6,38)	(5,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(6,77)	(44,37)	(7,07)	(6,21)	(6,43)	(5,86)
Schlussnettoinventarwert	7,98	57,01	8,32	9,34	7,73	9,01
Gesamtertrag	(45,90 %)	(43,77 %)	(45,94 %)	(39,94 %)	(45,41 %)	(39,41 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,85 %	1,86 %	1,78 %	1,78 %	0,95 %	0,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,39 %)	(1,41 %)	(1,35 %)	(1,32 %)	(0,50 %)	(0,50 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,24	100,00	14,88	13,81	13,58	13,10
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,23)	(1,35)	(0,24)	(0,23)	(0,09)	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,74	2,73	0,75	1,97	0,67	1,87
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,51	1,38	0,51	1,74	0,58	1,77
Schlussnettoinventarwert	14,75	101,38	15,39	15,55	14,16	14,87
Gesamtertrag	3,58 %	1,38 %	3,43 %	12,60 %	4,27 %	13,51 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,11 %	2,06 %	2,13 %	2,12 %	1,27 %	1,30 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,56 %)	(1,49 %)	(1,57 %)	(1,58 %)	(0,65 %)	(0,70 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## 5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR 15 €	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse GBP A £	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse HKD A HKD	Thesaurierende Klasse SGD A SGD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,72	15,33	15,43	12,20	15,70	31,05
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,01)	(0,24)	(0,15)	(0,05)	(0,15)	(0,28)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(5,74)	(5,95)	(6,83)	(4,34)	(6,75)	(13,50)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,75)	(6,19)	(6,98)	(4,39)	(6,90)	(13,78)
Schlussnettoinventarwert	6,97	9,14	8,45	7,81	8,80	17,27
Gesamtertrag	(45,20 %)	(40,38 %)	(45,24 %)	(35,98 %)	(43,95 %)	(44,38 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,53 %	2,57 %	1,86 %	0,99 %	1,81 %	1,76 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,10 %)	(2,11 %)	(1,40 %)	(0,52 %)	(1,35 %)	(1,32 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	12,15	13,73	14,84	11,46	15,03	29,80
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,04)	(0,35)	(0,23)	(0,08)	(0,23)	(0,46)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,61	1,95	0,82	0,82	0,90	1,71
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,57	1,60	0,59	0,74	0,67	1,25
Schlussnettoinventarwert	12,72	15,33	15,43	12,20	15,70	31,05
Gesamtertrag	4,69 %	11,65 %	3,98 %	6,46 %	4,46 %	4,19 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,82 %	2,97 %	2,08 %	1,25 %	2,05 %	2,05 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,34 %)	(2,41 %)	(1,54 %)	(0,66 %)	(1,52 %)	(1,51 %)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD I3 US\$	Thesaurierende Klasse USD I5 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,17	17,22	17,21	10,98	11,67	15,89
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,15)	(0,06)	(0,06)	(0,02)	(0,02)	(0,01)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(6,90)	(7,37)	(7,36)	(4,70)	(5,00)	(6,81)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(7,05)	(7,43)	(7,42)	(4,72)	(5,02)	(6,82)
Schlussnettoinventarwert	9,12	9,79	9,79	6,26	6,65	9,07
Gesamtertrag	(43,60 %)	(43,15 %)	(43,11 %)	(42,99 %)	(43,02 %)	(42,92 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,81 %	0,96 %	0,96 %	0,79 %	0,71 %	0,54 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,36 %)	(0,53 %)	(0,51 %)	(0,33 %)	(0,24 %)	(0,12 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	15,46	16,32	16,31	10,00	11,03	15,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,24)	(0,11)	(0,11)	(0,04)	(0,05)	(0,04)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,95	1,01	1,01	1,02	0,69	0,93
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,71	0,90	0,90	0,98	0,64	0,89
Schlussnettoinventarwert	16,17	17,22	17,21	10,98	11,67	15,89
Gesamtertrag	4,59 %	5,51 %	5,52 %	9,80 %	5,80 %	5,93 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,04 %	1,20 %	1,21 %	1,06 %	0,95 %	0,76 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,51 %)	(0,66 %)	(0,66 %)	(0,47 %)	(0,40 %)	(0,24 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## 5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	14,37	10,88
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,21)	0,03
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(6,12)	(4,67)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(6,33)	(4,64)
Schlussnettoinventarwert	8,04	6,24
Gesamtertrag	(44,05 %)	(42,65 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>		
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,61 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,15 %)	0,36 %
<b>31. Dezember 2021</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	13,86	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,33)	0,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,84	0,86
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,51	0,88
Schlussnettoinventarwert	14,37	10,88
Gesamtertrag	3,68 %	8,80 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>		
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,80 %	0,40 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,33 %)	0,20 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Asian Debt - Hard Currency

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,54	12,77	10,19	13,26	10,70	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,24	0,32	0,17	0,41	0,31	0,10
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,56)	(2,10)	(1,68)	(2,20)	(1,70)	0,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,32)	(1,78)	(1,51)	(1,79)	(1,39)	0,23
Ausschüttungen	(0,39)	–	–	–	(0,35)	(0,11)
Schlussnettoinventarwert	7,83	10,99	8,68	11,47	8,96	10,12
Gesamtertrag	(13,91 %)	(13,94 %)	(14,82 %)	(13,50 %)	(13,41 %)	2,30 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,39 %	1,39 %	2,39 %	0,79 %	0,78 %	0,52 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,86 %	2,84 %	1,83 %	3,45 %	3,47 %	3,69 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,17	13,01	10,49	13,43	11,24	–
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,26	0,35	0,17	0,44	0,35	–
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,44)	(0,59)	(0,47)	(0,61)	(0,48)	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,18)	(0,24)	(0,30)	(0,17)	(0,13)	–
Ausschüttungen	(0,45)	–	–	–	(0,41)	–
Schlussnettoinventarwert	9,54	12,77	10,19	13,26	10,70	–
Gesamtertrag	(1,87 %)	(1,84 %)	(2,86 %)	(1,27 %)	(1,23 %)	–

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,42 %	1,42 %	2,42 %	0,82 %	0,82 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,67 %	2,67 %	1,69 %	3,29 %	3,29 %	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I4* US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)* US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$	Thesaurierende Klasse USD Z* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,36	10,00	9,87	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,10	0,21	0,08	0,28	0,02
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,13	(1,71)	0,13	(1,61)	(0,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,23	(1,50)	0,21	(1,33)	0,01
Ausschüttungen	–	–	(0,11)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,23	8,86	10,10	8,54	10,01
Gesamtertrag	2,30 %	(14,48 %)	2,10 %	(13,48 %)	0,10 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,52 %	1,99 %	1,25 %	1,00 %	0,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,69 %	2,25 %	2,96 %	3,24 %	3,69 %
<b>31. Dezember 2021</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	–	10,62	–	10,00	–
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	0,22	–	0,21	–
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	(0,48)	–	(0,34)	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(0,26)	–	(0,13)	–
Ausschüttungen	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	–	10,36	–	9,87	–
Gesamtertrag	–	(2,45 %)	–	(1,30 %)	–
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	2,02 %	–	0,42 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	2,05 %	–	3,71 %	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

	Thesaurierende Klasse CNY I CNY	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) US\$	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	118,49	13,05	13,05
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,09	0,03	0,01
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(26,96)	(3,80)	(3,79)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(26,87)	(3,77)	(3,78)
Schlussnettoinventarwert	91,62	9,28	9,27
Gesamtertrag	(22,68 %)	(28,89 %)	(28,97 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,22 %	1,18 %	1,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,09 %	0,27 %	0,09 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	118,25	12,75	12,75
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,49	0,00	(0,03)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,25)	0,30	0,33
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,24	0,30	0,30
Schlussnettoinventarwert	118,49	13,05	13,05
Gesamtertrag	0,20 %	2,35 %	2,35 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,07 %	1,03 %	1,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,41 %	(0,02 %)	(0,25 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## China Bond

	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) CNY	Ausschüttende Klasse CNY I* CNY	Thesaurierende Klasse CNY Z CNY	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) SGD	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	89,21	88,94	121,51	9,69	18,30	11,85
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	1,42	0,07	3,54	0,24	0,28	0,26
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(7,23)	0,18	(10,23)	(0,93)	(2,89)	(1,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,81)	0,25	(6,69)	(0,69)	(2,61)	(1,63)
Ausschüttungen	(5,04)	–	–	–	(1,00)	–
Schlussnettoinventarwert	78,36	89,19	114,82	9,00	14,69	10,22
Gesamtertrag	(6,70 %)	0,25 %**	(5,51 %)	(7,12 %)	(14,73 %)	(13,76 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,57 %	0,86 %	0,27 %	0,78 %	1,45 %	0,87 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,71 %	2,36 %	3,00 %	2,57 %	1,66 %	2,40 %

\*Wiederaufnahme der Geschäfte am 12. Dezember 2022.

\*\*Die Gesamrendite für den Zeitraum von 1. Januar 2022 bis 15. November 2022 betrug (6,18) %.

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	95,44	101,25	120,79	10,00	18,78	11,61
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	2,69	3,45	5,02	0,34	0,50	0,41
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,28)	(3,44)	(4,30)	(0,65)	0,15	(0,17)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,59)	0,01	0,72	(0,31)	0,65	0,24
Ausschüttungen	(5,64)	(3,66)	–	–	(1,13)	–
Schlussnettoinventarwert	89,21	97,60	121,51	9,69	18,30	11,85
Gesamtertrag	(0,72 %)	(0,05 %)	0,60 %	(3,10 %)	3,49 %	2,07 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,49 %	0,90 %	0,23 %	0,74 %	1,59 %	0,94 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,92 %	3,43 %	4,20 %	3,66 %	2,66 %	3,43 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert US\$
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	10,13	11,26
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,28	0,30
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,92)	(1,78)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,64)	(1,48)
Schlussnettoinventarwert	9,49	9,78
Gesamtertrag	(6,32 %)	(13,14 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,26 %	0,26 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,92 %	2,92 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,35	10,96
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,43	0,43
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,65)	(0,13)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,22)	0,30
Schlussnettoinventarwert	10,13	11,26
Gesamtertrag	(2,13 %)	2,74 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,25 %	0,25 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,15 %	3,83 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## China Equity

	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Ausschüttende Klasse GBP A £	Thesaurierende Klasse SGD A SGD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,10	28,39	30,58	23,36	13,93	39,04
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,14	0,10	0,29	0,42	(0,20)	0,11
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(4,01)	(7,00)	(7,54)	(5,76)	(3,03)	(8,97)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,87)	(6,90)	(7,25)	(5,34)	(3,23)	(8,86)
Schlussnettoinventarwert	12,23	21,49	23,33	18,02	10,70	30,18
Gesamtertrag	(24,04 %)	(24,30 %)	(23,71 %)	(22,86 %)	(23,19 %)	(22,69 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,20 %	1,96 %	1,22 %	0,12 %	2,04 %	1,94 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,06 %	0,41 %	1,15 %	2,19 %	(1,39 %)	0,35 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	17,33	30,75	32,88	24,84	15,01	41,98
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,08	(0,10)	0,16	0,42	(0,04)	(0,15)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,31)	(2,26)	(2,46)	(1,90)	(1,04)	(2,79)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,23)	(2,36)	(2,30)	(1,48)	(1,08)	(2,94)
Schlussnettoinventarwert	16,10	28,39	30,58	23,36	13,93	39,04
Gesamtertrag	(7,10 %)	(7,67 %)	(7,00 %)	(5,96 %)	(7,17 %)	(7,00 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,42 %	2,26 %	1,48 %	0,35 %	2,23 %	2,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,45 %	(0,30 %)	0,48 %	1,61 %	(0,25 %)	(0,33 %)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD U US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	32,88	20,24	35,53	21,91	19,25	22,88
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,10	0,06	0,33	0,24	0,02	0,15
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(7,31)	(4,50)	(7,91)	(4,87)	(4,39)	(5,10)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(7,21)	(4,44)	(7,58)	(4,63)	(4,37)	(4,95)
Schlussnettoinventarwert	25,67	15,80	27,95	17,28	14,88	17,93
Gesamtertrag	(21,93 %)	(21,94 %)	(21,33 %)	(21,13 %)	(22,70 %)	(21,63 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,99 %	1,99 %	1,24 %	1,02 %	3,00 %	1,59 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,36 %	0,35 %	1,14 %	1,35 %	0,14 %	0,78 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	35,24	21,70	37,80	23,26	20,84	24,42
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,11)	(0,09)	0,18	0,16	(0,28)	0,04
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,25)	(1,36)	(2,45)	(1,51)	(1,31)	(1,58)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,36)	(1,45)	(2,27)	(1,35)	(1,59)	(1,54)
Ausschüttungen	–	(0,01)	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	32,88	20,24	35,53	21,91	19,25	22,88
Gesamtertrag	(6,70 %)	(6,67 %)	(6,01 %)	(5,80 %)	(7,63 %)	(6,31 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,18 %	2,18 %	1,43 %	1,20 %	3,18 %	1,78 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,31 %)	(0,41 %)	0,46 %	0,66 %	(1,31 %)	0,14 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	23,68
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,44
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(5,29)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,85)
Schlussnettoinventarwert	18,83
Gesamtertrag	(20,48 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,23 %
<b>31. Dezember 2021</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	24,91
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,41
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,64)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,23)
Schlussnettoinventarwert	23,68
Gesamtertrag	(4,94 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,55 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

	Thesaurierende Klasse EUR A* €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse GBP I2 £	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse SEK I SEK
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	11,21	9,24	9,37	11,60	113,40
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,43	0,83	0,62	0,65	0,89	8,01
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,76)	(1,81)	(1,41)	(1,31)	(1,65)	(17,37)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,33)	(0,98)	(0,79)	(0,66)	(0,76)	(9,36)
Ausschüttungen	–	–	(0,55)	(0,54)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,67	10,23	7,90	8,17	10,84	104,04
Gesamtertrag	(3,30 %)	(8,74 %)	(8,68 %)	(7,13 %)	(6,55 %)	(8,25 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,52 %	0,86 %	0,71 %	0,74 %	0,13 %	0,89 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	7,87 %	7,77 %	7,34 %	7,49 %	7,93 %	7,43 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	10,52	9,06	9,12	10,73	105,94
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	0,50	0,44	0,43	0,59	5,15
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	0,19	0,16	0,24	0,28	2,31
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	0,69	0,60	0,67	0,87	7,46
Ausschüttungen	–	–	(0,42)	(0,42)	–	–
Schlussnettoinventarwert	–	11,21	9,24	9,37	11,60	113,40
Gesamtertrag	–	6,56 %	6,73 %	7,49 %	8,11 %	7,04 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	0,93 %	0,80 %	0,78 %	0,17 %	0,96 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	4,60 %	4,75 %	4,62 %	5,25 %	4,67 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## CLO Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A* US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I5 US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	12,02	10,40	9,89	12,30
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,45	0,82	0,73	0,70	0,95
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,62)	(1,65)	(1,43)	(1,34)	(1,72)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,17)	(0,83)	(0,70)	(0,64)	(0,77)
Ausschüttungen	–	–	(0,61)	(0,60)	–
Schlussnettoinventarwert	9,83	11,19	9,09	8,65	11,53
Gesamtertrag	(1,70 %)	(6,91 %)	(6,82 %)	(6,54 %)	(6,26 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,60 %	0,87 %	0,71 %	0,49 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	8,33 %	7,19 %	7,71 %	7,79 %	8,17 %
<b>31. Dezember 2021</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	–	11,18	10,11	9,62	11,35
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	0,51	0,47	0,47	0,62
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	0,33	0,29	0,27	0,33
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	0,84	0,76	0,74	0,95
Ausschüttungen	–	–	(0,47)	(0,47)	–
Schlussnettoinventarwert	–	12,02	10,40	9,89	12,30
Gesamtertrag	–	7,51 %	7,66 %	7,83 %	8,37 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	0,92 %	0,76 %	0,56 %	0,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	4,40 %	4,56 %	4,79 %	5,17 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Commodities<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* £	Thesaurierende Klasse GBP I5* £	Thesaurierende Klasse USD A* US\$	Thesaurierende Klasse USD I* US\$	Thesaurierende Klasse USD I5* US\$	Thesaurierende Klasse USD M* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,01	0,07	(0,01)	(0,01)	0,06	(0,05)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,42	(0,65)	(0,28)	1,21	(0,28)	(1,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,43	(0,58)	(0,29)	1,20	(0,22)	(1,09)
Schlussnettoinventarwert	10,43	9,42	9,71	11,20	9,78	8,91
Gesamtertrag	4,30 %	(5,80 %)	(2,90 %)	12,00 %	(2,20 %)	(10,90 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,84 %	0,53 %	1,61 %	0,84 %	0,53 %	2,20 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,14 %	1,03 %	(0,14 %)	(0,08 %)	0,73 %	(0,84 %)

	Thesaurierende Klasse USD Z* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,12
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,20
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,32
Schlussnettoinventarwert	11,32
Gesamtertrag	11,64 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,27 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse CHF P CHF	Ausschüttende Klasse CHF P CHF	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) €	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,58	11,27	10,61	9,67	12,14	12,88
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,23	0,33	0,30	0,23	0,29	0,38
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,51)	(1,96)	(1,82)	(1,63)	(2,07)	(2,20)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,28)	(1,63)	(1,52)	(1,40)	(1,78)	(1,82)
Ausschüttungen	(0,42)	–	(0,30)	(0,36)	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,88	9,64	8,79	7,91	10,36	11,06
Gesamtertrag	(13,56 %)	(14,46 %)	(14,47 %)	(14,72 %)	(14,66 %)	(14,13 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,33 %	0,64 %	0,64 %	1,29 %	1,29 %	0,69 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,72 %	3,17 %	3,19 %	2,65 %	2,64 %	3,26 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	11,23	10,87	10,07	12,15	12,81
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,21	0,30	0,29	0,21	0,26	0,36
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,15)	(0,26)	(0,25)	(0,21)	(0,27)	(0,29)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,06	0,04	0,04	0,00	(0,01)	0,07
Ausschüttungen	(0,48)	–	(0,30)	(0,40)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,58	11,27	10,61	9,67	12,14	12,88
Gesamtertrag	0,55 %	0,36 %	0,37 %	(0,05 %)	(0,08 %)	0,55 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,31 %	0,66 %	0,66 %	1,32 %	1,32 %	0,73 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,15 %	2,67 %	2,67 %	2,16 %	2,16 %	2,76 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,80	11,86	9,85	11,97	13,12	12,82
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,31	0,36	0,29	0,37	0,42	0,24
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,82)	(2,02)	(1,66)	(2,04)	(2,24)	(2,18)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,51)	(1,66)	(1,37)	(1,67)	(1,82)	(1,94)
Ausschüttungen	(0,31)	–	(0,29)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,98	10,20	8,19	10,30	11,30	10,88
Gesamtertrag	(14,14 %)	(14,00 %)	(14,03 %)	(13,95 %)	(13,87 %)	(15,13 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,69 %	0,57 %	0,57 %	0,51 %	0,39 %	1,89 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,25 %	3,36 %	3,38 %	3,42 %	3,59 %	2,06 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,04	11,79	10,01	11,89	13,01	12,91
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,30	0,34	0,29	0,35	0,40	0,20
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,24)	(0,27)	(0,23)	(0,27)	(0,29)	(0,29)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,06	0,07	0,06	0,08	0,11	(0,09)
Ausschüttungen	(0,30)	–	(0,22)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,80	11,86	9,85	11,97	13,12	12,82
Gesamtertrag	0,55 %	0,59 %	0,59 %	0,67 %	0,85 %	(0,70 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,72 %	0,60 %	0,60 %	0,56 %	0,42 %	1,93 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,76 %	2,88 %	2,88 %	2,95 %	3,06 %	1,55 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR P €	Ausschüttende Klasse EUR P €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,33	11,46	10,84	12,08	11,88	10,76
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,17	0,34	0,32	0,37	0,38	0,33
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,57)	(1,96)	(1,83)	(1,91)	(1,88)	(1,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,40)	(1,62)	(1,51)	(1,54)	(1,50)	(1,35)
Ausschüttungen	(0,32)	–	(0,31)	–	–	(0,32)
Schlussnettoinventarwert	7,61	9,84	9,02	10,54	10,38	9,09
Gesamtertrag	(15,17 %)	(14,14 %)	(14,05 %)	(12,75 %)	(12,63 %)	(12,63 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,89 %	0,66 %	0,66 %	0,71 %	0,59 %	0,59 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,04 %	3,18 %	3,23 %	3,38 %	3,48 %	3,48 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,72	11,39	11,09	11,94	11,73	10,93
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,15	0,32	0,31	0,33	0,33	0,31
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,21)	(0,25)	(0,25)	(0,19)	(0,18)	(0,17)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,06)	0,07	0,06	0,14	0,15	0,14
Ausschüttungen	(0,33)	–	(0,31)	–	–	(0,31)
Schlussnettoinventarwert	9,33	11,46	10,84	12,08	11,88	10,76
Gesamtertrag	(0,62 %)	0,61 %	0,49 %	1,17 %	1,28 %	1,28 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,93 %	0,69 %	0,68 %	0,70 %	0,59 %	0,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,55 %	2,79 %	2,79 %	2,70 %	2,81 %	2,81 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP P £	Ausschüttende Klasse GBP P £	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,86	10,40	19,43	9,96	12,82	9,93
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,32	0,45	0,24	0,31	0,24
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,72)	(1,64)	(2,95)	(1,49)	(1,95)	(1,51)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,38)	(1,32)	(2,50)	(1,25)	(1,64)	(1,27)
Ausschüttungen	–	(0,30)	(0,86)	(0,45)	–	(0,22)
Schlussnettoinventarwert	9,48	8,78	16,07	8,26	11,18	8,44
Gesamtertrag	(12,71 %)	(12,77 %)	(13,05 %)	(12,77 %)	(12,79 %)	(12,83 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	0,68 %	1,27 %	1,30 %	1,30 %	1,30 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,42 %	3,42 %	2,61 %	2,68 %	2,68 %	2,70 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,73	10,56	20,23	10,39	12,72	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,30	0,29	0,41	0,21	0,27	0,15
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,17)	(0,16)	(0,25)	(0,13)	(0,17)	(0,13)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,13	0,13	0,16	0,08	0,10	0,02
Ausschüttungen	–	(0,29)	(0,96)	(0,51)	–	(0,09)
Schlussnettoinventarwert	10,86	10,40	19,43	9,96	12,82	9,93
Gesamtertrag	1,21 %	1,23 %	0,77 %	0,74 %	0,79 %	0,22 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	0,67 %	1,27 %	1,28 %	1,28 %	1,28 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,73 %	2,72 %	2,08 %	2,09 %	2,09 %	2,10 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,19	14,08	9,94	13,12	11,39	11,38
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,17	0,41	0,29	0,38	0,35	0,21
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,70)	(2,14)	(1,50)	(1,98)	(1,73)	(1,73)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,53)	(1,73)	(1,21)	(1,60)	(1,38)	(1,52)
Ausschüttungen	–	–	(0,28)	–	(0,33)	–
Schlussnettoinventarwert	9,66	12,35	8,45	11,52	9,68	9,86
Gesamtertrag	(13,67 %)	(12,29 %)	(12,28 %)	(12,20 %)	(12,20 %)	(13,36 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,32 %	0,69 %	0,70 %	0,57 %	0,57 %	1,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,67 %	3,22 %	3,32 %	3,20 %	3,52 %	2,07 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,22	13,89	10,00	12,93	11,55	11,37
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,12	0,37	0,19	0,36	0,32	0,17
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,15)	(0,18)	(0,13)	(0,17)	(0,15)	(0,16)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,03)	0,19	0,06	0,19	0,17	0,01
Ausschüttungen	–	–	(0,12)	–	(0,33)	–
Schlussnettoinventarwert	11,19	14,08	9,94	13,12	11,39	11,38
Gesamtertrag	(0,27 %)	1,37 %	0,58 %	1,47 %	1,45 %	0,09 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,25 %	0,70 %	0,75 %	0,58 %	0,58 %	1,86 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,12 %	2,68 %	2,71 %	2,79 %	2,79 %	1,50 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD P US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	9,87	12,54	13,42
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,18	0,37	0,48
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,48)	(1,91)	(2,06)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,30)	(1,54)	(1,58)
Ausschüttungen	(0,34)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,23	11,00	11,84
Gesamtertrag	(13,35 %)	(12,28 %)	(11,77 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,91 %	0,66 %	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,08 %	3,23 %	3,97 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,20	12,36	13,16
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,15	0,33	0,43
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,13)	(0,15)	(0,17)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,02	0,18	0,26
Ausschüttungen	(0,35)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,87	12,54	13,42
Gesamtertrag	0,15 %	1,46 %	1,98 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,87 %	0,66 %	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,51 %	2,70 %	3,24 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD I AUD	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* CAD	Thesaurierende Klasse CHF I2 CHF	Thesaurierende Klasse CHF P CHF	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,17	10,32	10,00	9,80	9,89	8,36
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,35	0,45	0,10	0,42	0,42	0,30
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,22)	(2,50)	0,94	(2,49)	(2,52)	(2,08)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,87)	(2,05)	1,04	(2,07)	(2,10)	(1,78)
Ausschüttungen	(0,42)	(0,46)	–	–	–	(0,38)
Schlussnettoinventarwert	6,88	7,81	11,04	7,73	7,79	6,20
Gesamtertrag	(20,61 %)	(20,07 %)	10,40 %	(21,12 %)	(21,23 %)	(21,52 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,53 %	0,82 %	0,60 %	0,64 %	0,74 %	1,48 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,67 %	5,38 %	5,75 %	5,27 %	5,13 %	4,50 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,11	11,16	–	10,25	10,35	9,28
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,45	–	0,43	0,42	0,31
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,77)	(0,86)	–	(0,88)	(0,88)	(0,77)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,43)	(0,41)	–	(0,45)	(0,46)	(0,46)
Ausschüttungen	(0,51)	(0,43)	–	–	–	(0,46)
Schlussnettoinventarwert	9,17	10,32	–	9,80	9,89	8,36
Gesamtertrag	(4,41 %)	(3,74 %)	–	(4,39 %)	(4,44 %)	(5,06 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,55 %	0,83 %	–	0,67 %	0,77 %	1,57 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,46 %	4,19 %	–	4,24 %	4,10 %	3,50 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,16	13,06	10,22	8,68	9,96	9,32
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,45	0,58	0,45	0,36	0,44	0,40
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,08)	(3,33)	(1,85)	(2,17)	(2,53)	(2,34)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,63)	(2,75)	(1,40)	(1,81)	(2,09)	(1,94)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,38)	–	(0,42)
Schlussnettoinventarwert	9,53	10,31	8,82	6,49	7,87	6,96
Gesamtertrag	(21,63 %)	(21,06 %)	(13,70 %)	(21,04 %)	(20,98 %)	(21,02 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,48 %	0,79 %	0,79 %	0,79 %	0,65 %	0,65 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,51 %	5,13 %	5,32 %	5,18 %	5,31 %	5,34 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,79	13,64	9,83	9,45	10,39	10,14
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,43	0,57	0,43	0,38	0,45	0,42
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,06)	(1,15)	(0,04)	(0,78)	(0,88)	(0,83)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,63)	(0,58)	0,39	(0,40)	(0,43)	(0,41)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,37)	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	12,16	13,06	10,22	8,68	9,96	9,32
Gesamtertrag	(4,93 %)	(4,25 %)	3,97 %	(4,36 %)	(4,14 %)	(4,16 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,57 %	0,84 %	0,84 %	0,84 %	0,69 %	0,69 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,47 %	4,24 %	4,24 %	4,25 %	4,35 %	4,39 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR I4 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Ausschüttende Klasse EUR M €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,16	10,12	12,60	10,00	11,51	8,44
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,50	0,50	0,58	0,28	0,35	0,25
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,83)	(1,86)	(3,21)	(0,28)	(2,91)	(2,10)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,33)	(1,36)	(2,63)	0,00	(2,56)	(1,85)
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,43)
Schlussnettoinventarwert	8,83	8,76	9,97	10,00	8,95	6,16
Gesamtertrag	(20,88 %)	(13,44 %)	(20,87 %)	0,00 %	(22,24 %)	(22,23 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,58 %	0,58 %	0,51 %	0,43 %	2,26 %	2,26 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,43 %	5,41 %	5,46 %	5,64 %	3,71 %	3,69 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,64	9,72	13,13	–	12,21	9,41
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,51	0,44	0,58	–	0,32	0,23
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,99)	(0,04)	(1,11)	–	(1,02)	(0,76)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,48)	0,40	(0,53)	–	(0,70)	(0,53)
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	11,16	10,12	12,60	–	11,51	8,44
Gesamtertrag	(4,12 %)	4,12 %	(4,04 %)	–	(5,73 %)	(5,75 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,62 %	0,62 %	0,55 %	–	2,40 %	2,41 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,47 %	4,41 %	4,53 %	–	2,65 %	2,62 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR P €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Ausschüttende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,11	10,41	11,92	9,11	10,45	9,47
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,46	0,51	0,54	0,42	0,49	0,43
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,59)	(2,65)	(2,91)	(2,21)	(2,55)	(2,28)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,13)	(2,14)	(2,37)	(1,79)	(2,06)	(1,85)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,41)	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	7,98	8,27	9,55	6,91	8,39	7,18
Gesamtertrag	(21,07 %)	(20,56 %)	(19,88 %)	(19,86 %)	(19,71 %)	(19,77 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,75 %	0,10 %	0,82 %	0,82 %	0,68 %	0,68 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,12 %	5,88 %	5,39 %	5,26 %	5,54 %	5,53 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,56	10,80	12,38	9,85	10,84	10,24
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,45	0,53	0,51	0,39	0,46	0,42
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,90)	(0,92)	(0,97)	(0,75)	(0,85)	(0,78)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,45)	(0,39)	(0,46)	(0,36)	(0,39)	(0,36)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,38)	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	10,11	10,41	11,92	9,11	10,45	9,47
Gesamtertrag	(4,26 %)	(3,61 %)	(3,72 %)	(3,73 %)	(3,60 %)	(3,60 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,80 %	0,11 %	0,82 %	0,82 %	0,68 %	0,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,39 %	4,97 %	4,21 %	4,20 %	4,29 %	4,26 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP P £	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) HKD	Thesaurierende Klasse JPY I ¥	Thesaurierende Klasse SEK A SEK	Thesaurierende Klasse SEK 12 SEK	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,68	9,73	1.033,60	116,99	98,00	18,39
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,48	0,36	45,90	4,52	4,77	0,66
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,60)	(2,26)	(263,19)	(29,73)	(25,24)	(4,29)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,12)	(1,90)	(217,29)	(25,21)	(20,47)	(3,63)
Ausschüttungen	–	(0,45)	–	–	–	(0,84)
Schlussnettoinventarwert	8,56	7,38	816,31	91,78	77,53	13,92
Gesamtertrag	(19,85 %)	(19,74 %)	(21,02 %)	(21,55 %)	(20,89 %)	(19,90 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,78 %	1,50 %	0,80 %	1,55 %	0,68 %	1,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,46 %	4,55 %	5,28 %	4,76 %	5,44 %	4,45 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,09	10,70	1.074,93	122,77	100,00	20,21
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,46	0,35	45,23	4,30	2,90	0,65
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,87)	(0,78)	(86,56)	(10,08)	(4,90)	(1,45)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,41)	(0,43)	(41,33)	(5,78)	(2,00)	(0,80)
Ausschüttungen	–	(0,54)	–	–	–	(1,02)
Schlussnettoinventarwert	10,68	9,73	1.033,60	116,99	98,00	18,39
Gesamtertrag	(3,70 %)	(4,16 %)	(3,84 %)	(4,71 %)	(2,00 %)	(4,10 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,78 %	1,51 %	0,84 %	1,59 %	0,71 %	1,51 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,18 %	3,37 %	4,28 %	3,58 %	4,78 %	3,39 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,06	13,99	10,06	10,60	14,86	10,02
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,53	0,37	0,32	0,66	0,43
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,09)	(3,26)	(2,32)	(2,47)	(3,48)	(2,31)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,75)	(2,73)	(1,95)	(2,15)	(2,82)	(1,88)
Ausschüttungen	(0,42)	–	(0,37)	–	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	6,89	11,26	7,74	8,45	12,04	7,70
Gesamtertrag	(19,53 %)	(19,51 %)	(19,54 %)	(20,28 %)	(18,98 %)	(18,95 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,50 %	1,50 %	1,50 %	2,50 %	0,80 %	0,80 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,56 %	4,58 %	4,62 %	3,58 %	5,29 %	5,26 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,95	14,58	10,73	11,16	15,37	10,79
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,32	0,48	0,36	0,25	0,62	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,71)	(1,07)	(0,79)	(0,81)	(1,13)	(0,77)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,39)	(0,59)	(0,43)	(0,56)	(0,51)	(0,35)
Ausschüttungen	(0,50)	–	(0,24)	–	–	(0,42)
Schlussnettoinventarwert	9,06	13,99	10,06	10,60	14,86	10,02
Gesamtertrag	(4,04 %)	(4,05 %)	(4,01 %)	(5,02 %)	(3,32 %)	(3,34 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,51 %	1,51 %	1,48 %	2,51 %	0,81 %	0,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,41 %	3,37 %	3,48 %	2,32 %	4,07 %	4,10 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I3 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD P US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,87	9,71	9,89	10,67	8,52	11,03
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,60	0,43	0,44	0,34	0,26	0,49
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,02)	(2,23)	(2,28)	(2,49)	(1,96)	(2,57)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,42)	(1,80)	(1,84)	(2,15)	(1,70)	(2,08)
Ausschüttungen	–	(0,44)	(0,45)	–	(0,43)	–
Schlussnettoinventarwert	10,45	7,47	7,60	8,52	6,39	8,95
Gesamtertrag	(18,80 %)	(18,74 %)	(18,77 %)	(20,15 %)	(20,22 %)	(18,86 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,66 %	0,66 %	0,59 %	2,30 %	2,30 %	0,77 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,40 %	5,38 %	5,50 %	3,78 %	3,79 %	5,31 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,30	10,46	10,65	11,21	9,39	11,41
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,55	0,42	0,44	0,28	0,23	0,46
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,98)	(0,75)	(0,77)	(0,82)	(0,66)	(0,84)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,43)	(0,33)	(0,33)	(0,54)	(0,43)	(0,38)
Ausschüttungen	–	(0,42)	(0,43)	–	(0,44)	–
Schlussnettoinventarwert	12,87	9,71	9,89	10,67	8,52	11,03
Gesamtertrag	(3,23 %)	(3,24 %)	(3,14 %)	(4,82 %)	(4,74 %)	(3,33 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,67 %	0,66 %	0,60 %	2,31 %	2,31 %	0,77 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,16 %	4,21 %	4,28 %	2,54 %	2,53 %	4,07 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD X US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	10,03	12,27
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,46	0,64
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,34)	(2,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,88)	(2,25)
Schlussnettoinventarwert	8,15	10,02
Gesamtertrag	(18,74 %)	(18,34 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,55 %	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,60 %	5,77 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	12,61
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,02	0,61
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,01	(0,95)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,03	(0,34)
Schlussnettoinventarwert	10,03	12,27
Gesamtertrag	0,30 %	(2,70 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,73 %	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,62 %	4,86 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency

	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD C2 AUD	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD E AUD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	4,65	9,06	4,64	9,05	4,66	9,05
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,11	0,22	0,11	0,23	0,11	0,22
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,83)	(1,66)	(0,83)	(1,67)	(0,84)	(1,66)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,72)	(1,44)	(0,72)	(1,44)	(0,73)	(1,44)
Ausschüttungen	(0,39)	–	(0,39)	–	(0,39)	–
Schlussnettoinventarwert	3,54	7,62	3,53	7,61	3,54	7,61
Gesamtertrag	(15,78 %)	(15,89 %)	(15,84 %)	(15,91 %)	(15,97 %)	(15,91 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,04 %	3,03 %	3,03 %	3,03 %	3,04 %	3,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,74 %	2,77 %	2,68 %	2,57 %	2,70 %	2,77 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	5,83	10,28	5,84	10,28	5,84	10,27
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,10	0,19	0,10	0,19	0,11	0,20
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,76)	(1,41)	(0,78)	(1,42)	(0,76)	(1,42)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,66)	(1,22)	(0,68)	(1,23)	(0,65)	(1,22)
Ausschüttungen	(0,52)	–	(0,52)	–	(0,53)	–
Schlussnettoinventarwert	4,65	9,06	4,64	9,05	4,66	9,05
Gesamtertrag	(11,82 %)	(11,87 %)	(12,16 %)	(11,96 %)	(11,78 %)	(11,88 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,14 %	3,15 %	3,15 %	3,15 %	3,15 %	3,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,92 %	1,90 %	1,81 %	1,88 %	1,93 %	1,95 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD T AUD	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	4,97	9,66	7,75	8,25	9,93	11,69
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,16	0,32	0,28	0,35	0,45	0,55
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,90)	(1,77)	(1,51)	(1,61)	(1,16)	(1,38)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,74)	(1,45)	(1,23)	(1,26)	(0,71)	(0,83)
Ausschüttungen	(0,42)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	3,81	8,21	6,52	6,99	9,22	10,86
Gesamtertrag	(15,20 %)	(15,01 %)	(15,87 %)	(15,27 %)	(7,15 %)	(7,10 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,00 %	2,00 %	1,65 %	0,90 %	0,89 %	0,75 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,84 %	3,85 %	3,39 %	4,69 %	4,75 %	4,84 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	6,17	10,85	8,72	9,21	10,19	11,98
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,17	0,31	0,28	0,36	0,41	0,51
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,81)	(1,50)	(1,25)	(1,32)	(0,67)	(0,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,64)	(1,19)	(0,97)	(0,96)	(0,26)	(0,29)
Ausschüttungen	(0,56)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	4,97	9,66	7,75	8,25	9,93	11,69
Gesamtertrag	(10,95 %)	(10,97 %)	(11,12 %)	(10,42 %)	(2,55 %)	(2,42 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,10 %	2,09 %	1,80 %	1,01 %	1,01 %	0,87 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,01 %	3,06 %	3,35 %	4,14 %	4,14 %	4,34 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) £	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,12	9,89	8,89	9,83	7,69	9,36
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,38	0,48	0,39	0,50	0,38	0,49
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,93)	(1,15)	(1,63)	(0,66)	(0,51)	(0,63)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,55)	(0,67)	(1,24)	(0,16)	(0,13)	(0,14)
Ausschüttungen	(0,37)	–	–	–	(0,36)	–
Schlussnettoinventarwert	7,20	9,22	7,65	9,67	7,20	9,22
Gesamtertrag	(6,87 %)	(6,77 %)	(13,95 %)	(1,63 %)	(1,63 %)	(1,50 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,60 %	0,51 %	0,93 %	0,63 %	0,64 %	0,54 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,05 %	5,13 %	4,93 %	5,21 %	5,17 %	5,29 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,68	10,00	9,86	10,72	8,76	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,37	0,43	0,38	0,44	0,35	0,40
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,57)	(0,54)	(1,35)	(1,33)	(1,07)	(1,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,20)	(0,11)	(0,97)	(0,89)	(0,72)	(0,64)
Ausschüttungen	(0,36)	–	–	–	(0,35)	–
Schlussnettoinventarwert	8,12	9,89	8,89	9,83	7,69	9,36
Gesamtertrag	(2,29 %)	(1,10 %)	(9,84 %)	(8,30 %)	(8,32 %)	(6,40 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,70 %	0,60 %	0,99 %	0,69 %	0,68 %	0,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,45 %	4,61 %	4,04 %	4,34 %	4,35 %	4,43 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SEK A SEK	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD B US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	95,54	13,26	5,84	8,99	5,14	9,36
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	3,50	0,44	0,20	0,32	0,12	0,23
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(18,58)	(2,29)	(0,98)	(1,53)	(0,86)	(1,60)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(15,08)	(1,85)	(0,78)	(1,21)	(0,74)	(1,37)
Ausschüttungen	–	(0,75)	(0,33)	–	(0,43)	–
Schlussnettoinventarwert	80,46	10,66	4,73	7,78	3,97	7,99
Gesamtertrag	(15,78 %)	(14,02 %)	(13,38 %)	(13,46 %)	(14,56 %)	(14,64 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,71 %	1,61 %	1,67 %	1,66 %	2,97 %	2,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,17 %	3,95 %	4,04 %	4,07 %	2,70 %	2,66 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	107,28	15,77	6,94	10,01	6,41	10,55
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	3,45	0,47	0,20	0,31	0,11	0,19
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(15,19)	(2,04)	(0,88)	(1,33)	(0,80)	(1,38)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(11,74)	(1,57)	(0,68)	(1,02)	(0,69)	(1,19)
Ausschüttungen	–	(0,94)	(0,42)	–	(0,58)	–
Schlussnettoinventarwert	95,54	13,26	5,84	8,99	5,14	9,36
Gesamtertrag	(10,94 %)	(10,26 %)	(10,19 %)	(10,19 %)	(11,35 %)	(11,28 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,82 %	1,74 %	1,73 %	1,73 %	3,04 %	3,04 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,39 %	3,21 %	3,23 %	3,22 %	1,88 %	1,89 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD C2 US\$	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD E US\$	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	5,14	9,36	5,14	9,36	9,23	9,60
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,12	0,23	0,12	0,23	0,38	0,41
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,86)	(1,60)	(0,86)	(1,60)	(1,56)	(1,65)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,74)	(1,37)	(0,74)	(1,37)	(1,18)	(1,24)
Ausschüttungen	(0,43)	–	(0,43)	–	(0,53)	–
Schlussnettoinventarwert	3,97	7,99	3,97	7,99	7,52	8,36
Gesamtertrag	(14,56 %)	(14,64 %)	(14,56 %)	(14,64 %)	(12,87 %)	(12,92 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,97 %	2,96 %	2,97 %	2,96 %	0,91 %	0,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,70 %	2,65 %	2,73 %	2,75 %	4,80 %	4,82 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,41	10,56	6,41	10,55	10,00	10,59
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,11	0,19	0,11	0,19	0,14	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,80)	(1,39)	(0,80)	(1,38)	(0,76)	(1,39)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,69)	(1,20)	(0,69)	(1,19)	(0,62)	(0,99)
Ausschüttungen	(0,58)	–	(0,58)	–	(0,15)	–
Schlussnettoinventarwert	5,14	9,36	5,14	9,36	9,23	9,60
Gesamtertrag	(11,35 %)	(11,36 %)	(11,35 %)	(11,28 %)	(6,22 %)	(9,35 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,04 %	3,05 %	3,05 %	3,05 %	0,94 %	0,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,88 %	1,87 %	1,88 %	1,91 %	4,46 %	3,96 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD I5 US\$	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD T US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,34	9,30	10,74	5,58	9,99	9,45
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,41	(1.994,20)	0,17	0,33	0,44
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,41)	(1,59)	1.992,54	(0,93)	(1,71)	(1,62)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,07)	(1,18)	(1,66)	(0,76)	(1,38)	(1,18)
Ausschüttungen	(0,33)	–	–	(0,47)	–	–
Schlussnettoinventarwert	6,94	8,12	9,08	4,35	8,61	8,27
Gesamtertrag	(12,85 %)	(12,69 %)	(15,46 %)	(13,76 %)	(13,81 %)	(12,49 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,93 %	0,76 %	–	1,96 %	1,95 %	0,48 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,72 %	4,96 %	(21401,14 %)	3,78 %	3,79 %	5,26 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,59	10,25	11,93	6,88	11,15	10,39
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,35	0,40	0,49	0,18	0,31	0,44
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,24)	(1,35)	(1,68)	(0,86)	(1,47)	(1,38)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,89)	(0,95)	(1,19)	(0,68)	(1,16)	(0,94)
Ausschüttungen	(0,36)	–	–	(0,62)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,34	9,30	10,74	5,58	9,99	9,45
Gesamtertrag	(9,46 %)	(9,27 %)	(9,97 %)	(10,34 %)	(10,40 %)	(9,05 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,98 %	0,82 %	0,61 %	2,03 %	2,03 %	0,52 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,97 %	4,12 %	4,25 %	2,92 %	2,94 %	4,44 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Y US\$	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,18	47,97	122,85	47,95	122,83	47,96
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,42	1,16	3,18	1,17	3,37	1,17
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,57)	(6,89)	(18,06)	(6,89)	(18,23)	(6,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,15)	(5,73)	(14,88)	(5,72)	(14,86)	(5,72)
Ausschüttungen	–	(5,66)	–	(5,66)	–	(5,66)
Schlussnettoinventarwert	8,03	36,58	107,97	36,57	107,97	36,58
Gesamtertrag	(12,53 %)	(12,08 %)	(12,11 %)	(12,07 %)	0,00 %	(12,07 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,52 %	3,08 %	3,08 %	3,09 %	3,09 %	3,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,23 %	2,80 %	2,81 %	2,76 %	2,66 %	2,77 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	60,32	133,54	60,30	133,52	60,32
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,40	1,10	2,62	1,11	2,59	1,11
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,22)	(5,60)	(13,31)	(5,62)	(13,28)	(5,62)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,82)	(4,50)	(10,69)	(4,51)	(10,69)	(4,51)
Ausschüttungen	–	(7,85)	–	(7,84)	–	(7,85)
Schlussnettoinventarwert	9,18	47,97	122,85	47,95	122,83	47,96
Gesamtertrag	(8,20 %)	(8,00 %)	(8,01 %)	(8,01 %)	(8,01 %)	(8,02 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,58 %	3,28 %	3,28 %	3,29 %	3,29 %	3,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,37 %	2,03 %	2,03 %	2,01 %	2,00 %	2,01 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	122,85	51,24	131,23
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	3,20	1,66	4,58
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(18,07)	(7,36)	(19,32)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(14,87)	(5,70)	(14,74)
Ausschüttungen	–	(6,07)	–
Schlussnettoinventarwert	107,98	39,47	116,49
Gesamtertrag	(12,10 %)	(11,19 %)	(11,23 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,09 %	2,03 %	2,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,74 %	3,91 %	3,93 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	133,56	63,79	141,21
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	2,55	1,79	4,28
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(13,26)	(6,01)	(14,26)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(10,71)	(4,22)	(9,98)
Ausschüttungen	–	(8,33)	–
Schlussnettoinventarwert	122,85	51,24	131,23
Gesamtertrag	(8,02 %)	(7,07 %)	(7,07 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,29 %	2,20 %	2,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,96 %	3,13 %	3,15 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend

	Ausschüttende Klasse AUD I3 AUD	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,87	11,09	11,31	8,29	11,60	8,07
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,41	0,43	0,51	0,36	0,53	0,36
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,39)	(1,86)	(1,90)	(1,36)	(1,94)	(1,33)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,98)	(1,43)	(1,39)	(1,00)	(1,41)	(0,97)
Ausschüttungen	(0,40)	–	–	(0,36)	–	(0,36)
Schlussnettoinventarwert	7,49	9,66	9,92	6,93	10,19	6,74
Gesamtertrag	(11,15 %)	(12,89 %)	(12,29 %)	(12,26 %)	(12,16 %)	(12,21 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	1,55 %	0,87 %	0,87 %	0,73 %	0,73 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,38 %	4,28 %	4,91 %	4,92 %	4,98 %	4,99 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,53	11,49	11,63	8,87	11,91	8,64
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,39	0,38	0,47	0,35	0,49	0,35
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,66)	(0,78)	(0,79)	(0,58)	(0,80)	(0,57)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,27)	(0,40)	(0,32)	(0,23)	(0,31)	(0,22)
Ausschüttungen	(0,39)	–	–	(0,35)	–	(0,35)
Schlussnettoinventarwert	8,87	11,09	11,31	8,29	11,60	8,07
Gesamtertrag	(2,90 %)	(3,48 %)	(2,75 %)	(2,70 %)	(2,60 %)	(2,62 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,72 %	1,67 %	0,94 %	0,94 %	0,80 %	0,79 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,27 %	3,37 %	4,10 %	4,09 %	4,11 %	4,22 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR Z €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,91	10,69	12,22	10,79	7,54	12,06
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,25	0,53	0,59	0,34	0,22	0,62
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,32)	(1,41)	(2,05)	(1,81)	(1,22)	(2,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,07)	(0,88)	(1,46)	(1,47)	(1,00)	(1,41)
Ausschüttungen	(0,36)	–	–	–	(0,49)	–
Schlussnettoinventarwert	7,48	9,81	10,76	9,32	6,05	10,65
Gesamtertrag	(12,11 %)	(8,23 %)	(11,95 %)	(13,62 %)	(13,51 %)	(11,69 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,65 %	0,59 %	0,52 %	2,34 %	2,34 %	0,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,19 %	5,24 %	5,25 %	3,43 %	3,37 %	5,63 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,54	10,51	12,53	11,27	8,35	12,32
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,40	0,46	0,55	0,28	0,20	0,59
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,64)	(0,28)	(0,86)	(0,76)	(0,55)	(0,85)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,24)	0,18	(0,31)	(0,48)	(0,35)	(0,26)
Ausschüttungen	(0,39)	–	–	–	(0,46)	–
Schlussnettoinventarwert	8,91	10,69	12,22	10,79	7,54	12,06
Gesamtertrag	(2,56 %)	1,71 %	(2,47 %)	(4,26 %)	(4,28 %)	(2,11 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,73 %	0,65 %	0,57 %	2,51 %	2,51 %	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,25 %	4,38 %	4,47 %	2,52 %	2,53 %	4,83 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £	Ausschüttende Klasse GBP I £	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,71	10,26	8,95	9,09	10,26	10,18
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,55	0,48	0,41	0,44	0,48	0,51
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,61)	(0,81)	(1,22)	(0,73)	(1,41)	(0,84)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,06)	(0,33)	(0,81)	(0,29)	(0,93)	(0,33)
Ausschüttungen	–	–	(0,39)	(0,41)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,65	9,93	7,75	8,39	9,33	9,85
Gesamtertrag	(9,05 %)	(3,22 %)	(9,08 %)	(3,16 %)	(9,06 %)	(3,24 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,90 %	0,91 %	0,90 %	0,90 %	0,88 %	0,87 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,10 %	4,60 %	5,10 %	5,14 %	5,04 %	5,13 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,40	10,79	9,86	9,96	10,85	10,71
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,48	0,42	0,37	0,38	0,43	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,17)	(0,95)	(0,90)	(0,87)	(1,02)	(0,95)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,69)	(0,53)	(0,53)	(0,49)	(0,59)	(0,53)
Ausschüttungen	–	–	(0,38)	(0,38)	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,71	10,26	8,95	9,09	10,26	10,18
Gesamtertrag	(5,56 %)	(4,91 %)	(5,52 %)	(5,00 %)	(5,44 %)	(4,95 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,92 %	0,92 %	0,91 %	0,92 %	0,88 %	0,88 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,98 %	3,99 %	4,02 %	4,01 %	4,10 %	4,04 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse NOK U NOK	Thesaurierende Klasse SEK A SEK	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,60	110,49	114,14	15,39	7,79	12,29
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,68	4,80	4,68	0,55	0,28	0,46
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,74)	(15,54)	(15,23)	(2,83)	(1,41)	(2,26)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,06)	(10,74)	(10,55)	(2,28)	(1,13)	(1,80)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,80)	(0,40)	–
Schlussnettoinventarwert	11,54	99,75	103,59	12,31	6,26	10,49
Gesamtertrag	(8,41 %)	(9,72 %)	(9,24 %)	(15,04 %)	(14,64 %)	(14,65 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,18 %	1,25 %	1,62 %	1,54 %	1,58 %	1,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,85 %	4,74 %	4,43 %	4,20 %	4,32 %	4,31 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	13,24	116,34	116,56	17,33	8,85	13,14
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,61	4,14	3,95	0,55	0,27	0,41
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,25)	(9,99)	(6,37)	(1,50)	(0,83)	(1,26)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,64)	(5,85)	(2,42)	(0,95)	(0,56)	(0,85)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,99)	(0,50)	–
Schlussnettoinventarwert	12,60	110,49	114,14	15,39	7,79	12,29
Gesamtertrag	(4,83 %)	(5,03 %)	(2,08 %)	(5,70 %)	(6,53 %)	(6,47 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,21 %	1,29 %	1,69 %	1,58 %	1,60 %	1,61 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,71 %	3,61 %	3,39 %	3,47 %	3,27 %	3,19 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD I3 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,74	11,47	9,38	8,61	10,43	9,79
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,28	0,49	0,40	0,38	0,48	0,30
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,79)	(2,11)	(1,70)	(1,57)	(1,93)	(1,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,51)	(1,62)	(1,30)	(1,19)	(1,45)	(1,50)
Ausschüttungen	–	–	(0,39)	(0,37)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,23	9,85	7,69	7,05	8,98	8,29
Gesamtertrag	(15,50 %)	(14,12 %)	(13,98 %)	(13,96 %)	(13,90 %)	(15,32 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,58 %	0,88 %	0,88 %	0,74 %	0,67 %	2,38 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,32 %	4,78 %	4,75 %	5,13 %	5,24 %	3,48 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,52	12,18	10,37	9,52	11,05	10,55
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,23	0,47	0,39	0,37	0,45	0,24
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,01)	(1,18)	(0,98)	(0,90)	(1,07)	(1,00)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,78)	(0,71)	(0,59)	(0,53)	(0,62)	(0,76)
Ausschüttungen	–	–	(0,40)	(0,38)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,74	11,47	9,38	8,61	10,43	9,79
Gesamtertrag	(7,41 %)	(5,83 %)	(5,85 %)	(5,73 %)	(5,61 %)	(7,20 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,61 %	0,90 %	0,90 %	0,76 %	0,69 %	2,42 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,21 %	3,95 %	3,94 %	4,09 %	4,16 %	2,38 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	7,56	13,52
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,22	0,68
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,37)	(2,50)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,15)	(1,82)
Ausschüttungen	(0,47)	–
Schlussnettoinventarwert	5,94	11,70
Gesamtertrag	(15,37 %)	(13,46 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,38 %	0,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,54 %	5,72 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	8,63	14,26
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,19	0,65
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,79)	(1,39)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,60)	(0,74)
Ausschüttungen	(0,47)	–
Schlussnettoinventarwert	7,56	13,52
Gesamtertrag	(7,18 %)	(5,19 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,42 %	0,20 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,38 %	4,64 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

	Thesaurierende Klasse AUD I2 AUD	Thesaurierende Klasse NOK I NOK	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	9,93	116,42	12,07	10,04	11,99
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,29	3,35	0,33	0,29	0,39
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,55)	(16,66)	(2,06)	(1,72)	(2,05)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,26)	(13,31)	(1,73)	(1,43)	(1,66)
Schlussnettoinventarwert	8,67	103,11	10,34	8,61	10,33
Gesamtertrag	(12,69 %)	(11,43 %)	(14,33 %)	(14,24 %)	(13,84 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,74 %	0,89 %	0,81 %	0,73 %	0,27 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,32 %	3,20 %	3,17 %	3,26 %	3,66 %
<b>31. Dezember 2021</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	121,36	12,70	10,00	12,54
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,22	2,83	0,28	0,20	0,35
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,29)	(7,77)	(0,91)	(0,16)	(0,90)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,07)	(4,94)	(0,63)	0,04	(0,55)
Schlussnettoinventarwert	9,93	116,42	12,07	10,04	11,99
Gesamtertrag	(0,70 %)	(4,07 %)	(4,96 %)	0,40 %	(4,39 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,77 %	0,92 %	0,86 %	0,75 %	0,26 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,52 %	2,46 %	2,33 %	2,49 %	2,93 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Thesaurierende Klasse AUD C2 AUD	Thesaurierende Klasse AUD E AUD	Thesaurierende Klasse AUD T AUD	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) CAD	Ausschüttende Klasse CAD I2 CAD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,57	12,57	12,56	13,22	9,67	10,16
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,15)	(0,16)	(0,12)	(0,02)	0,07	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,29)	(3,28)	(3,32)	(3,51)	(1,84)	(2,60)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,44)	(3,44)	(3,44)	(3,53)	(1,77)	(2,52)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,03)	0,00
Schlussnettoinventarwert	9,13	9,13	9,12	9,69	7,87	7,64
Gesamtertrag	(27,37 %)	(27,37 %)	(27,39 %)	(26,70 %)	(18,34 %)	(24,79 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,35 %	3,35 %	3,35 %	2,33 %	1,33 %	1,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,42 %)	(1,52 %)	(1,22 %)	(0,21 %)	0,82 %	1,01 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,57	13,58	13,57	14,13	10,30	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,22)	(0,17)	(0,26)	(0,07)	0,02	0,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,78)	(0,84)	(0,75)	(0,84)	(0,57)	0,14
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,00)	(1,01)	(1,01)	(0,91)	(0,55)	0,16
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,08)	–
Schlussnettoinventarwert	12,57	12,57	12,56	13,22	9,67	10,16
Gesamtertrag	(7,37 %)	(7,44 %)	(7,44 %)	(6,44 %)	(5,42 %)	1,60 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,59 %	3,57 %	3,60 %	2,56 %	1,48 %	0,78 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,61 %)	(1,30 %)	(1,85 %)	(0,52 %)	0,17 %	4,36 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,68	13,67	9,85	13,06	15,52	12,53
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,05	(0,14)	0,14	0,08	0,18	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,13)	(3,66)	(2,66)	(3,37)	(3,98)	(3,07)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,08)	(3,80)	(2,52)	(3,29)	(3,80)	(3,09)
Schlussnettoinventarwert	8,60	9,87	7,33	9,77	11,72	9,44
Gesamtertrag	(26,37 %)	(27,80 %)	(25,58 %)	(25,19 %)	(24,48 %)	(24,66 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,26 %	3,23 %	0,27 %	1,31 %	0,28 %	2,28 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,47 %	(1,26 %)	1,72 %	0,76 %	1,30 %	(0,20 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,37	14,78	10,33	13,76	16,19	13,27
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,08	(0,24)	0,17	0,08	0,26	(0,06)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,77)	(0,87)	(0,65)	(0,78)	(0,93)	(0,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,69)	(1,11)	(0,48)	(0,70)	(0,67)	(0,74)
Schlussnettoinventarwert	11,68	13,67	9,85	13,06	15,52	12,53
Gesamtertrag	(5,58 %)	(7,51 %)	(4,65 %)	(5,09 %)	(4,14 %)	(5,58 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,52 %	3,62 %	0,48 %	1,49 %	0,47 %	2,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,65 %	(1,63 %)	1,65 %	0,58 %	1,59 %	(0,42 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD B US\$	Thesaurierende Klasse USD C2 US\$	Thesaurierende Klasse USD E US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD T US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,34	13,33	13,33	14,00	14,21	14,04
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,15)	(0,15)	(0,12)	0,09	(0,15)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,23)	(3,23)	(3,27)	(3,43)	(3,46)	(3,48)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,38)	(3,38)	(3,39)	(3,34)	(3,61)	(3,47)
Schlussnettoinventarwert	9,96	9,95	9,94	10,66	10,60	10,57
Gesamtertrag	(25,34 %)	(25,36 %)	(25,43 %)	(23,86 %)	(25,40 %)	(24,72 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,28 %	3,28 %	3,28 %	1,28 %	3,28 %	2,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,35 %)	(1,36 %)	(1,15 %)	0,79 %	(1,30 %)	0,12 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	14,27	14,27	14,27	14,68	15,20	14,87
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,21)	(0,23)	(0,28)	0,09	(0,23)	(0,07)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,72)	(0,71)	(0,66)	(0,77)	(0,76)	(0,76)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,93)	(0,94)	(0,94)	(0,68)	(0,99)	(0,83)
Schlussnettoinventarwert	13,34	13,33	13,33	14,00	14,21	14,04
Gesamtertrag	(6,52 %)	(6,59 %)	(6,59 %)	(4,63 %)	(6,51 %)	(5,58 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,47 %	3,48 %	3,51 %	1,47 %	3,48 %	2,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,48 %)	(1,61 %)	(1,90 %)	0,57 %	(1,48 %)	(0,46 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$	Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	14,23	159,43	159,42	159,43	168,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,19	(2,17)	(2,29)	(1,88)	(0,27)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,48)	(35,75)	(35,63)	(36,04)	(38,40)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,29)	(37,92)	(37,92)	(37,92)	(38,67)
Schlussnettoinventarwert	10,94	121,51	121,50	121,51	129,33
Gesamtertrag	(23,12 %)	(23,78 %)	(23,79 %)	(23,78 %)	(23,02 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,28 %	3,41 %	3,41 %	3,41 %	2,37 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,57 %	(1,58 %)	(1,67 %)	(1,41 %)	(0,20 %)
<b>31. Dezember 2021</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	14,77	164,45	164,43	164,44	171,56
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,27	(2,78)	(3,05)	(2,85)	(0,92)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,81)	(2,24)	(1,96)	(2,16)	(2,64)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,54)	(5,02)	(5,01)	(5,01)	(3,56)
Schlussnettoinventarwert	14,23	159,43	159,42	159,43	168,00
Gesamtertrag	(3,66 %)	(3,05 %)	(3,05 %)	(3,05 %)	(2,08 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,45 %	3,75 %	3,76 %	3,75 %	2,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,81 %	(1,63 %)	(1,78 %)	(1,66 %)	(0,52 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Select Equity

	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) ¥	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I5 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,88	1.294,74	11,79	11,33
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,04	5,20	0,04	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,22)	(186,99)	(2,99)	(2,88)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,18)	(181,79)	(2,95)	(2,80)
Schlussnettoinventarwert	8,70	1.112,95	8,84	8,53
Gesamtertrag	(20,04 %)	(14,04 %)	(25,02 %)	(24,71 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,13 %	1,15 %	1,14 %	0,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,39 %	0,44 %	0,44 %	0,82 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,55	1.210,66	12,29	11,77
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,07	10,78	0,10	0,04
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,26	73,30	(0,60)	(0,48)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,33	84,08	(0,50)	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	10,88	1.294,74	11,79	11,33
Gesamtertrag	3,13 %	6,94 %	(4,07 %)	(3,74 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,31 %	1,35 %	1,29 %	0,85 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,60 %	0,81 %	0,81 %	0,31 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Euro Bond Absolute Return

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	11,04	10,73	11,04	11,11
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,21	0,21	0,24	0,28
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,73)	(0,70)	(0,73)	(0,53)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,52)	(0,49)	(0,49)	(0,25)
Ausschüttungen	–	(0,20)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,52	10,04	10,55	10,86
Gesamtertrag	(4,71 %)	(4,58 %)	(4,44 %)	(2,25 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	0,69 %	0,46 %	0,24 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,97 %	2,08 %	2,26 %	2,58 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,69	10,53	10,67	10,62
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,15	0,15	0,18	0,20
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,20	0,18	0,19	0,29
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,35	0,33	0,37	0,49
Ausschüttungen	–	(0,13)	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,04	10,73	11,04	11,11
Gesamtertrag	3,27 %	3,19 %	3,47 %	4,61 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,76 %	0,75 %	0,54 %	0,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,37 %	1,43 %	1,68 %	1,82 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Euro Opportunistic Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	11,80	11,42
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,29	0,25
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,13)	(2,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,84)	(1,78)
Ausschüttungen	–	(0,23)
Schlussnettoinventarwert	9,96	9,41
Gesamtertrag	(15,59 %)	(15,68 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,57 %	0,57 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,75 %	2,48 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,69	11,47
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,19	0,18
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,08)	(0,07)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,11	0,11
Ausschüttungen	–	(0,16)
Schlussnettoinventarwert	11,80	11,42
Gesamtertrag	0,94 %	0,94 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,57 %	0,57 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,58 %	1,57 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## European High Yield Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR X €	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,64	12,65	11,91	9,97	15,39	12,87
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,46	0,29	0,45	0,27	0,53	0,48
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,76)	(1,63)	(1,54)	(1,08)	(1,69)	(1,40)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,30)	(1,34)	(1,09)	(0,81)	(1,16)	(0,92)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,53)	–	–
Schlussnettoinventarwert	12,34	11,31	10,82	8,63	14,23	11,95
Gesamtertrag	(9,53 %)	(10,59 %)	(9,15 %)	(8,12 %)	(7,54 %)	(7,15 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,81 %	2,01 %	0,41 %	1,43 %	0,82 %	0,42 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,68 %	2,49 %	4,07 %	3,04 %	3,72 %	4,05 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,13	12,33	11,43	10,17	14,70	12,25
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,49	0,30	0,47	0,29	0,52	0,49
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,02	0,02	0,01	0,11	0,17	0,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,51	0,32	0,48	0,40	0,69	0,62
Ausschüttungen	–	–	–	(0,60)	–	–
Schlussnettoinventarwert	13,64	12,65	11,91	9,97	15,39	12,87
Gesamtertrag	3,88 %	2,60 %	4,20 %	4,06 %	4,69 %	5,06 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,84 %	2,03 %	0,43 %	1,39 %	0,82 %	0,41 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,60 %	2,41 %	4,01 %	2,86 %	3,42 %	3,96 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	12,09
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,49
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,33)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,84)
Schlussnettoinventarwert	11,25
Gesamtertrag	(6,95 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,33 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,48
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,48
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,61
Schlussnettoinventarwert	12,09
Gesamtertrag	5,31 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,23 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,09 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity<sup>2</sup>

	Ausschüttende Klasse EUR A* €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	12,14	12,15	10,37	10,57	11,97
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,02)	0,05	0,07	0,06	0,08	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,05)	(3,08)	(3,10)	(2,64)	(2,69)	(3,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,07)	(3,03)	(3,03)	(2,58)	(2,61)	(3,14)
Ausschüttungen	–	–	(0,03)	0,00	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,93	9,11	9,09	7,79	7,96	8,83
Gesamtertrag	(20,70 %)	(24,96 %)	(25,02 %)	(24,86 %)	(24,69 %)	(26,23 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,66 %	0,75 %	0,75 %	0,59 %	0,46 %	2,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,24 %)	0,53 %	0,68 %	0,72 %	0,89 %	(1,10 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	(0,18)	(0,12)	0,00	(0,03)	(0,35)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	2,32	2,30	0,37	0,60	2,32
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	2,14	2,18	0,37	0,57	1,97
Ausschüttungen	–	–	(0,03)	0,00	–	–
Schlussnettoinventarwert	–	12,14	12,15	10,37	10,57	11,97
Gesamtertrag	–	21,40 %	21,50 %	3,70 %	5,70 %	19,70 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	2,90 %	1,82 %	0,27 %	0,97 %	4,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	(1,79 %)	(1,18 %)	0,21 %	(0,51 %)	(3,62 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) US\$	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) US\$	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	12,09	11,50	11,58	11,43
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,00	(0,02)	0,05	(0,09)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,97)	(3,45)	(3,48)	(3,43)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,97)	(3,47)	(3,43)	(3,52)
Schlussnettoinventarwert	9,12	8,03	8,15	7,91
Gesamtertrag	(24,57 %)	(30,17 %)	(29,62 %)	(30,80 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,29 %	1,64 %	0,77 %	2,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,03 %)	(0,27 %)	0,60 %	(1,08 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,05)	(0,22)	(0,76)	(0,29)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	2,14	1,72	2,34	1,72
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,09	1,50	1,58	1,43
Ausschüttungen	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	12,09	11,50	11,58	11,43
Gesamtertrag	20,90 %	15,00 %	15,80 %	14,30 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,39 %	3,55 %	10,29 %	4,33 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,57 %)	(2,45 %)	(8,18 %)	(3,23 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Event Driven<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse GBP I5 £	Ausschüttende Klasse GBP I5 £	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I5 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,02)	(0,02)	(0,03)	(0,04)	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,13	0,13	0,13	0,16	0,15
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,11	0,11	0,10	0,12	0,13
Schlussnettoinventarwert	10,11	10,11	10,10	10,12	10,13
Gesamtertrag	1,10 %	1,10 %	1,00 %	1,20 %	1,30 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,76 %	1,72 %	2,42 %	2,70 %	1,94 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,13 %)	(1,10 %)	(1,79 %)	(2,07 %)	(1,30 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Bond

	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte* US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,22	10,29	10,00	11,42	10,76	9,38
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,11	0,06	0,07	0,20	0,09	0,11
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,69)	(1,78)	0,11	(1,99)	(1,85)	(1,61)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,58)	(1,72)	0,18	(1,79)	(1,76)	(1,50)
Ausschüttungen	(0,20)	–	–	–	–	(0,21)
Schlussnettoinventarwert	7,44	8,57	10,18	9,63	9,00	7,67
Gesamtertrag	(17,25 %)	(16,72 %)	1,80 %	(15,67 %)	(16,36 %)	(16,15 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,12 %	1,83 %	0,62 %	0,52 %	1,41 %	1,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,42 %	0,63 %	2,48 %	1,97 %	0,95 %	1,39 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,97	–	12,00	11,43	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,08	0,01	–	0,18	0,06	0,08
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,67)	(0,69)	–	(0,76)	(0,73)	(0,50)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,59)	(0,68)	–	(0,58)	(0,67)	(0,42)
Ausschüttungen	(0,19)	–	–	–	–	(0,20)
Schlussnettoinventarwert	9,22	10,29	–	11,42	10,76	9,38
Gesamtertrag	(5,90 %)	(6,20 %)	–	(4,83 %)	(5,86 %)	(4,27 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,26 %	2,03 %	–	0,62 %	1,63 %	1,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,96 %	0,13 %	–	1,52 %	0,53 %	0,93 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	11,94	92,85
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,24	1,16
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,08)	(13,12)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,84)	(11,96)
Ausschüttungen	–	(5,39)
Schlussnettoinventarwert	10,10	75,50
Gesamtertrag	(15,41 %)	(13,12 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,21 %	1,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,26 %	1,43 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	12,50	100,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,24	0,88
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,80)	(2,56)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,56)	(1,68)
Ausschüttungen	–	(5,47)
Schlussnettoinventarwert	11,94	92,85
Gesamtertrag	(4,48 %)	(1,69 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,22 %	1,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,93 %	1,01 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse GBP I £	Ausschüttende Klasse HKD A HKD	Ausschüttende Klasse SGD A SGD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,33	9,90	9,79	9,99	9,90	20,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,35	0,32	0,36	0,38	0,33	0,65
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,01)	(0,94)	(0,94)	(0,82)	(0,81)	(1,56)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,66)	(0,62)	(0,58)	(0,44)	(0,48)	(0,91)
Ausschüttungen	–	(0,34)	(0,38)	(0,39)	(0,34)	(0,69)
Schlussnettoinventarwert	9,67	8,94	8,83	9,16	9,08	18,40
Gesamtertrag	(6,39 %)	(6,28 %)	(6,00 %)	(4,41 %)	(4,88 %)	(4,56 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,87 %	0,87 %	0,47 %	0,49 %	0,88 %	0,86 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,51 %	3,51 %	3,91 %	4,06 %	3,56 %	3,47 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,46	10,48	10,34	10,51	10,38	21,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,40	0,38	0,41	0,41	0,36	0,73
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,53)	(0,50)	(0,48)	(0,41)	(0,40)	(0,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,13)	(0,12)	(0,07)	0,00	(0,04)	(0,07)
Ausschüttungen	–	(0,46)	(0,48)	(0,52)	(0,44)	(0,93)
Schlussnettoinventarwert	10,33	9,90	9,79	9,99	9,90	20,00
Gesamtertrag	(1,24 %)	(1,25 %)	(0,72 %)	(0,06 %)	(0,46 %)	(0,35 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,92 %	0,93 %	0,51 %	0,50 %	0,90 %	0,90 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,74 %	3,71 %	4,13 %	4,04 %	3,58 %	3,58 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$	Ausschüttende Klasse USD X US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,47	10,00	10,53	10,01	10,53	10,01
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,36	0,33	0,40	0,37	0,40	0,37
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,82)	(0,76)	(0,82)	(0,77)	(0,83)	(0,76)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,46)	(0,43)	(0,42)	(0,40)	(0,43)	(0,39)
Ausschüttungen	–	(0,34)	–	(0,38)	–	(0,38)
Schlussnettoinventarwert	10,01	9,23	10,11	9,23	10,10	9,24
Gesamtertrag	(4,39 %)	(4,28 %)	(3,99 %)	(3,99 %)	(4,08 %)	(3,94 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,88 %	0,88 %	0,48 %	0,48 %	0,53 %	0,53 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,57 %	3,57 %	3,96 %	3,97 %	3,92 %	3,91 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,51	10,51	10,53	10,53	10,53	10,53
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,38	0,37	0,42	0,41	0,41	0,40
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,42)	(0,41)	(0,42)	(0,41)	(0,41)	(0,40)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,04)	(0,04)	0,00	0,00	0,00	0,00
Ausschüttungen	–	(0,47)	–	(0,52)	–	(0,52)
Schlussnettoinventarwert	10,47	10,00	10,53	10,01	10,53	10,01
Gesamtertrag	(0,38 %)	(0,41 %)	0,00 %	0,01 %	0,00 %	(0,06 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,89 %	0,89 %	0,49 %	0,49 %	0,54 %	0,54 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,57 %	3,58 %	3,98 %	4,00 %	3,92 %	3,92 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	15,15	14,54	14,03	15,09	14,04	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,25)	(0,13)	(0,25)	(0,02)	(0,23)	0,05
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,22)	(1,98)	(1,91)	(2,06)	(1,91)	(1,28)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,47)	(2,11)	(2,16)	(2,08)	(2,14)	(1,23)
Schlussnettoinventarwert	13,68	12,43	11,87	13,01	11,90	8,77
Gesamtertrag	(9,70 %)	(14,51 %)	(15,40 %)	(13,78 %)	(15,24 %)	(12,30 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,74 %	1,98 %	2,98 %	1,14 %	2,78 %	0,25 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,72 %)	(0,99 %)	(2,00 %)	(0,13 %)	(1,80 %)	0,67 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,13	12,42	12,10	12,76	12,10	–
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,36)	(0,22)	(0,36)	(0,05)	(0,33)	–
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,38	2,34	2,29	2,38	2,27	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,02	2,12	1,93	2,33	1,94	–
Schlussnettoinventarwert	15,15	14,54	14,03	15,09	14,04	–
Gesamtertrag	24,90 %	17,07 %	15,95 %	18,26 %	16,03 %	–
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,29 %	2,29 %	3,34 %	1,34 %	3,18 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,42 %)	(1,48 %)	(2,58 %)	(0,36 %)	(2,35 %)	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Flexible Credit Income

	Thesaurierende Klasse CAD I5 CAD	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse GBP I5 £	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,39	11,01	10,67	11,70	10,88	11,70
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,52	0,49	0,33	0,57	0,43	0,53
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,57)	(1,81)	(1,75)	(1,78)	(1,57)	(1,69)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,05)	(1,32)	(1,42)	(1,21)	(1,14)	(1,16)
Schlussnettoinventarwert	9,34	9,69	9,25	10,49	9,74	10,54
Gesamtertrag	(10,11 %)	(11,99 %)	(13,31 %)	(10,34 %)	(10,48 %)	(9,91 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,41 %	0,69 %	2,07 %	0,41 %	1,30 %	0,70 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,46 %	4,89 %	3,48 %	5,31 %	4,36 %	4,97 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,77	10,58	11,33	10,61	11,34
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,35	0,46	0,27	0,51	0,35	0,45
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,04	(0,22)	(0,18)	(0,14)	(0,08)	(0,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,39	0,24	0,09	0,37	0,27	0,36
Schlussnettoinventarwert	10,39	11,01	10,67	11,70	10,88	11,70
Gesamtertrag	3,90 %	2,23 %	0,85 %	3,27 %	2,54 %	3,17 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,43 %	0,74 %	2,22 %	0,42 %	1,35 %	0,75 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,31 %	4,22 %	2,61 %	4,41 %	3,24 %	3,82 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	11,09	10,76	11,81
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,49	0,34	0,59
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,58)	(1,54)	(1,70)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,09)	(1,20)	(1,11)
Ausschüttungen	(0,47)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,53	9,56	10,70
Gesamtertrag	(9,89 %)	(11,15 %)	(9,40 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,70 %	2,10 %	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,93 %	3,54 %	5,40 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,21	10,59	11,38
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,45	0,26	0,54
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,11)	(0,09)	(0,11)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,34	0,17	0,43
Ausschüttungen	(0,46)	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,09	10,76	11,81
Gesamtertrag	3,10 %	1,61 %	3,78 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,74 %	2,15 %	0,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,99 %	2,44 %	4,64 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global High Yield SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD I*	Thesaurierende Klasse CHF I4*	Ausschüttende Klasse CHF I4*	Thesaurierende Klasse CHF X*	Thesaurierende Klasse EUR I4*	Ausschüttende Klasse EUR I4*
	AUD	CHF	CHF	CHF	€	€
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,32	0,32	0,32	0,28	0,32	0,32
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,89)	(0,79)	(0,79)	(0,79)	(0,81)	(0,81)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,57)	(0,47)	(0,47)	(0,51)	(0,49)	(0,49)
Ausschüttungen	(0,07)	–	(0,21)	–	–	(0,21)
Schlussnettoinventarwert	9,36	9,53	9,32	9,49	9,51	9,30
Gesamtertrag	(5,65 %)	(4,70 %)	(4,70 %)	(5,10 %)	(4,90 %)	(4,87 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,71 %	0,46 %	0,46 %	1,16 %	0,46 %	0,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,09 %	5,03 %	5,05 %	4,41 %	5,03 %	5,05 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR X* €	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) €	Thesaurierende Klasse GBP I4* £	Thesaurierende Klasse GBP X* £	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	12,25	10,00	10,00	12,78	13,35
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,28	0,61	0,33	0,29	0,51	0,61
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,82)	(2,18)	(0,70)	(0,70)	(2,00)	(2,10)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,54)	(1,57)	(0,37)	(0,41)	(1,49)	(1,49)
Schlussnettoinventarwert	9,46	10,68	9,63	9,59	11,29	11,86
Gesamtertrag	(5,40 %)	(12,82 %)	(3,70 %)	(4,10 %)	(11,66 %)	(11,16 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,16 %	0,24 %	0,47 %	1,20 %	1,34 %	0,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,41 %	5,46 %	5,19 %	4,55 %	4,42 %	5,02 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	–	11,85	–	–	12,39	12,87
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	0,67	–	–	0,55	0,63
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	(0,27)	–	–	(0,16)	(0,15)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	0,40	–	–	0,39	0,48
Schlussnettoinventarwert	–	12,25	–	–	12,78	13,35
Gesamtertrag	–	3,38 %	–	–	3,15 %	3,73 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	–	0,33 %	–	–	1,41 %	0,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	5,55 %	–	–	4,34 %	4,88 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I4* US\$	Ausschüttende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	9,32	10,76	13,79
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,31	0,46	0,71
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,64)	(1,43)	(1,69)	(2,18)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,30)	(1,12)	(1,23)	(1,47)
Ausschüttungen	–	(0,48)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,70	7,72	9,53	12,32
Gesamtertrag	(3,00 %)	(12,19 %)	(11,43 %)	(10,66 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,48 %	1,94 %	1,08 %	0,14 %
	5,33 %	3,83 %	4,74 %	5,66 %
<b>31. Dezember 2021</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	–	9,63	10,32	13,21
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	0,34	0,56	0,74
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	(0,10)	(0,12)	(0,16)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	0,24	0,44	0,58
Ausschüttungen	–	(0,55)	–	–
Schlussnettoinventarwert	–	9,32	10,76	13,79
Gesamtertrag	–	2,50 %	4,26 %	4,39 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	2,02 %	0,41 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	3,62 %	5,24 %	5,46 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$	Thesaurierende Klasse USD Y US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,62	9,94	10,45	10,28
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,41	0,38	0,44	0,44
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,63)	(1,51)	(1,61)	(1,59)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,22)	(1,13)	(1,17)	(1,15)
Ausschüttungen	–	(0,38)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,40	8,43	9,28	9,13
Gesamtertrag	(11,49 %)	(11,52 %)	(11,20 %)	(11,19 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,81 %	0,81 %	0,41 %	0,39 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,28 %	4,27 %	4,68 %	4,70 %
<b>31. Dezember 2021</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,33	10,05	10,13	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,42	0,40	0,45	0,38
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,13)	(0,13)	(0,13)	(0,10)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,29	0,27	0,32	0,28
Ausschüttungen	–	(0,38)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,62	9,94	10,45	10,28
Gesamtertrag	2,81 %	2,74 %	3,16 %	2,80 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,69 %	0,70 %	0,29 %	0,27 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,02 %	4,01 %	4,42 %	4,46 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	9,88	9,88	9,89
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,26	0,26	0,27
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,70)	(1,68)	(1,69)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,44)	(1,42)	(1,42)
Schlussnettoinventarwert	8,44	8,46	8,47
Gesamtertrag	(14,57 %)	(14,37 %)	(14,36 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,46 %	0,25 %	0,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,16 %	2,92 %	3,02 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,06	0,07	0,07
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,18)	(0,19)	(0,18)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,12)	(0,12)	(0,11)
Schlussnettoinventarwert	9,88	9,88	9,89
Gesamtertrag	(1,20 %)	(1,20 %)	(1,10 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,46 %	0,27 %	0,17 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,00 %	2,19 %	2,29 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,08	10,59	11,59	12,32	11,02	11,65
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,28	0,32	0,29	0,34	0,32	0,35
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,64)	(1,60)	(1,66)	(1,75)	(1,58)	(1,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,36)	(1,28)	(1,37)	(1,41)	(1,26)	(1,33)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,26)	–
Schlussnettoinventarwert	8,72	9,31	10,22	10,91	9,50	10,32
Gesamtertrag	(13,49 %)	(12,09 %)	(11,82 %)	(11,44 %)	(11,52 %)	(11,42 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,57 %	0,58 %	0,94 %	0,60 %	0,58 %	0,51 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,13 %	3,26 %	2,76 %	2,96 %	3,18 %	3,25 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,07	10,51	11,54	12,22	11,21	11,55
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,30	0,30	0,27	0,34	0,30	0,33
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,29)	(0,22)	(0,22)	(0,24)	(0,21)	(0,23)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,01	0,08	0,05	0,10	0,09	0,10
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,28)	–
Schlussnettoinventarwert	10,08	10,59	11,59	12,32	11,02	11,65
Gesamtertrag	0,10 %	0,76 %	0,43 %	0,82 %	0,81 %	0,87 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,66 %	0,63 %	1,04 %	0,64 %	0,65 %	0,57 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,90 %	2,80 %	2,33 %	2,76 %	2,69 %	2,82 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	11,31
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,37
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,64)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,27)
Schlussnettoinventarwert	10,04
Gesamtertrag	(11,23 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,23 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,54 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,17
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,36
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,22)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,14
Schlussnettoinventarwert	11,31
Gesamtertrag	1,25 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,25 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,16 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

	Ausschüttende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD CI US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,86	13,96	14,07	15,48	13,30	11,98
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,18	(0,01)	0,30	0,32	0,10	(0,01)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,18)	(4,08)	(3,12)	(4,43)	(3,57)	(3,20)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,00)	(4,09)	(2,82)	(4,11)	(3,47)	(3,21)
Ausschüttungen	(0,17)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,69	9,87	11,25	11,37	9,83	8,77
Gesamtertrag	(27,80 %)	(29,30 %)	(20,04 %)	(26,55 %)	(26,09 %)	(26,79 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	2,77 %	0,31 %	0,32 %	1,82 %	2,82 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,05 %	(0,11 %)	2,38 %	2,44 %	0,87 %	(0,12 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	11,24	10,17	12,10	10,50	9,55
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,06	(0,11)	0,22	0,24	0,02	(0,09)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,84	2,83	3,68	3,14	2,78	2,52
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,90	2,72	3,90	3,38	2,80	2,43
Ausschüttungen	(0,04)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,86	13,96	14,07	15,48	13,30	11,98
Gesamtertrag	9,00 %	24,20 %	38,35 %	27,93 %	26,67 %	25,45 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,94 %	3,24 %	0,73 %	0,71 %	2,17 %	3,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,17 %	(0,87 %)	1,80 %	1,76 %	0,19 %	(0,87 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I5 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	16,86	12,03	12,29	17,07
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,24	0,20	(0,03)	0,34
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(4,55)	(3,22)	(3,27)	(4,60)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,31)	(3,02)	(3,30)	(4,26)
Ausschüttungen	–	(0,19)	–	–
Schlussnettoinventarwert	12,55	8,82	8,99	12,81
Gesamtertrag	(25,56 %)	(25,27 %)	(26,85 %)	(24,96 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,07 %	0,69 %	2,82 %	0,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,69 %	2,02 %	(0,29 %)	2,40 %
<b>31. Dezember 2021</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	13,21	9,64	9,79	13,27
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,15	0,12	(0,07)	0,29
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,50	2,53	2,57	3,51
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,65	2,65	2,50	3,80
Ausschüttungen	–	(0,26)	–	–
Schlussnettoinventarwert	16,86	12,03	12,29	17,07
Gesamtertrag	27,63 %	28,03 %	25,54 %	28,64 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,37 %	0,92 %	3,03 %	0,44 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,95 %	1,07 %	(0,61 %)	1,69 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,18	12,96	12,68	12,20	12,22	10,24
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,02	(0,19)	0,05	(0,01)	0,02	(0,07)
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,10)	(3,04)	(2,98)	(2,34)	(2,34)	(2,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,08)	(3,23)	(2,93)	(2,35)	(2,32)	(2,96)
Schlussnettoinventarwert	10,10	9,73	9,75	9,85	9,90	7,28
Gesamtertrag	(23,37 %)	(24,92 %)	(23,11 %)	(19,26 %)	(18,99 %)	(28,91 %)

**Verhältnis zum  
durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,43 %	2,40 %	0,14 %	0,77 %	0,45 %	1,64 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,19 %	(1,80 %)	0,46 %	(0,06 %)	0,21 %	(0,95 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,03)	(0,25)	0,00	(0,05)	(0,02)	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,21	3,21	2,68	2,25	2,24	0,26
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,18	2,96	2,68	2,20	2,22	0,24
Schlussnettoinventarwert	13,18	12,96	12,68	12,20	12,22	10,24
Gesamtertrag	31,80 %	29,60 %	26,80 %	22,00 %	22,20 %	2,40 %

**Verhältnis zum  
durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,83 %	3,06 %	0,63 %	1,22 %	0,91 %	1,84 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,31 %)	(2,48 %)	(0,01 %)	(0,58 %)	(0,28 %)	(1,48 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	12,33	12,33	12,10	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,01)	(0,01)	(0,18)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,49)	(3,48)	(3,38)	(1,69)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,50)	(3,49)	(3,56)	(1,68)
Schlussnettoinventarwert	8,83	8,84	8,54	8,32
Gesamtertrag	(28,39 %)	(28,30 %)	(29,42 %)	(16,80 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,74 %	0,73 %	2,42 %	0,20 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,13 %)	(0,10 %)	(1,81 %)	0,20 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	–
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,06)	(0,06)	(0,22)	–
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	2,39	2,39	2,32	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,33	2,33	2,10	–
Schlussnettoinventarwert	12,33	12,33	12,10	–
Gesamtertrag	23,30 %	23,30 %	21,00 %	–

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,09 %	1,10 %	2,69 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,51 %)	(0,61 %)	(2,24 %)	–



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD A AUD	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,91	15,93	6,24	10,24	6,25	6,30
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,71	0,18	0,30	0,18	0,18
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,39)	(2,86)	(1,09)	(1,83)	(1,09)	(1,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,05)	(2,15)	(0,91)	(1,53)	(0,91)	(0,91)
Ausschüttungen	(0,43)	–	(0,38)	–	(0,38)	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	6,43	13,78	4,95	8,71	4,96	5,00
Gesamtertrag	(13,52 %)	(13,50 %)	(14,90 %)	(14,94 %)	(14,87 %)	(14,86 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,33 %	1,34 %	2,97 %	2,97 %	2,97 %	2,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,88 %	4,86 %	3,20 %	3,24 %	3,16 %	3,14 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	8,11	15,39	6,58	10,06	6,59	6,63
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,66	0,17	0,25	0,17	0,17
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,06)	(0,12)	(0,06)	(0,07)	(0,06)	(0,05)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,28	0,54	0,11	0,18	0,11	0,12
Ausschüttungen	(0,48)	–	(0,45)	–	(0,45)	(0,45)
Schlussnettoinventarwert	7,91	15,93	6,24	10,24	6,25	6,30
Gesamtertrag	3,57 %	3,51 %	1,72 %	1,79 %	1,73 %	1,92 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,36 %	1,36 %	3,03 %	3,00 %	3,03 %	3,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,21 %	4,22 %	2,57 %	2,48 %	2,57 %	2,58 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse AUD E AUD	Ausschüttende Klasse AUD I AUD	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD T AUD	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) CAD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,54	11,10	7,13	6,89	13,75	8,06
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,33	0,54	0,27	0,26	0,53	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,05)	(1,96)	(1,25)	(1,21)	(2,45)	(1,36)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,72)	(1,42)	(0,98)	(0,95)	(1,92)	(1,01)
Ausschüttungen	–	(0,53)	(0,44)	(0,42)	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	9,82	9,15	5,71	5,52	11,83	6,61
Gesamtertrag	(14,90 %)	(13,01 %)	(14,09 %)	(14,08 %)	(13,96 %)	(12,76 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,98 %	0,73 %	1,95 %	1,95 %	1,94 %	1,36 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,01 %	5,39 %	4,27 %	4,25 %	4,38 %	4,96 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,33	11,18	7,43	7,18	13,37	8,26
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,29	0,54	0,26	0,25	0,49	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,08)	(0,09)	(0,05)	(0,05)	(0,11)	(0,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,21	0,45	0,21	0,20	0,38	0,29
Ausschüttungen	–	(0,53)	(0,51)	(0,49)	–	(0,49)
Schlussnettoinventarwert	11,54	11,10	7,13	6,89	13,75	8,06
Gesamtertrag	1,85 %	4,11 %	2,93 %	2,90 %	2,84 %	3,62 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,02 %	0,75 %	1,99 %	1,99 %	2,00 %	1,33 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,53 %	4,84 %	3,58 %	3,59 %	3,60 %	4,11 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse CHF A CHF	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Thesaurierende Klasse CHF I2 CHF	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) CNY	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) CNY	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,46	14,25	12,20	89,36	93,83	7,53
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,56	0,68	0,59	3,89	4,72	0,31
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,55)	(2,71)	(2,32)	(14,15)	(15,00)	(1,40)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,99)	(2,03)	(1,73)	(10,26)	(10,28)	(1,09)
Ausschüttungen	–	–	–	(5,85)	(6,16)	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	11,47	12,22	10,47	73,25	77,39	6,03
Gesamtertrag	(14,78 %)	(14,25 %)	(14,18 %)	(11,77 %)	(11,23 %)	(14,81 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,27 %	0,66 %	0,59 %	1,35 %	0,74 %	1,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,63 %	5,56 %	5,30 %	4,93 %	5,05 %	4,66 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	13,10	13,78	11,79	90,13	94,08	7,76
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,54	0,65	0,57	3,59	4,29	0,32
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,18)	(0,18)	(0,16)	2,08	2,20	(0,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,36	0,47	0,41	5,67	6,49	0,23
Ausschüttungen	–	–	–	(6,44)	(6,74)	(0,46)
Schlussnettoinventarwert	13,46	14,25	12,20	89,36	93,83	7,53
Gesamtertrag	2,75 %	3,41 %	3,48 %	6,52 %	7,15 %	3,04 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,31 %	0,72 %	0,61 %	1,30 %	0,69 %	1,36 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,06 %	4,66 %	4,73 %	4,01 %	4,57 %	4,22 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	21,61	8,62	19,02	8,30	13,33	8,19
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,92	0,36	0,92	0,39	0,65	0,38
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(4,11)	(1,61)	(3,64)	(1,56)	(2,54)	(1,53)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,19)	(1,25)	(2,72)	(1,17)	(1,89)	(1,15)
Ausschüttungen	–	(0,36)	–	(0,39)	–	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	18,42	7,01	16,30	6,74	11,44	6,65
Gesamtertrag	(14,76 %)	(14,73 %)	(14,30 %)	(14,32 %)	(14,18 %)	(14,23 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,28 %	1,29 %	0,69 %	0,70 %	0,59 %	0,56 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,70 %	4,70 %	5,31 %	5,22 %	5,46 %	5,95 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	20,99	8,73	18,35	8,40	12,86	8,29
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,90	0,37	0,91	0,41	0,65	0,44
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,28)	(0,12)	(0,24)	(0,11)	(0,18)	(0,14)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,62	0,25	0,67	0,30	0,47	0,30
Ausschüttungen	–	(0,36)	–	(0,40)	–	(0,40)
Schlussnettoinventarwert	21,61	8,62	19,02	8,30	13,33	8,19
Gesamtertrag	2,95 %	2,95 %	3,65 %	3,64 %	3,65 %	3,72 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,37 %	1,37 %	0,75 %	0,75 %	0,64 %	0,68 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,23 %	4,24 %	4,87 %	4,88 %	4,95 %	5,08 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) £	Thesaurierende Klasse GBP A £	Ausschüttende Klasse GBP A £	Thesaurierende Klasse GBP I £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,23	12,60	7,60	14,87	9,18	17,89
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,46	0,67	0,33	0,66	0,40	0,90
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,33)	(2,40)	(1,31)	(2,62)	(1,60)	(3,17)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,87)	(1,73)	(0,98)	(1,96)	(1,20)	(2,27)
Ausschüttungen	–	–	(0,42)	–	(0,39)	–
Schlussnettoinventarwert	10,36	10,87	6,20	12,91	7,59	15,62
Gesamtertrag	(15,29 %)	(13,73 %)	(13,21 %)	(13,18 %)	(13,27 %)	(12,69 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,86 %	0,10 %	1,34 %	1,34 %	1,34 %	0,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,17 %	5,90 %	4,82 %	4,90 %	4,86 %	5,52 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,94	12,09	7,79	14,35	9,23	17,16
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,43	0,68	0,32	0,61	0,38	0,83
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,14)	(0,17)	(0,05)	(0,09)	(0,05)	(0,10)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,29	0,51	0,27	0,52	0,33	0,73
Ausschüttungen	–	–	(0,46)	–	(0,38)	–
Schlussnettoinventarwert	12,23	12,60	7,60	14,87	9,18	17,89
Gesamtertrag	2,43 %	4,22 %	3,60 %	3,62 %	3,66 %	4,25 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,00 %	0,12 %	1,34 %	1,34 %	1,34 %	0,73 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,59 %	5,48 %	4,15 %	4,14 %	4,15 %	4,75 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) HKD	Thesaurierende Klasse SEK A SEK
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,93	14,29	8,79	13,72	7,97	146,45
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,49	0,73	0,43	0,77	0,33	6,55
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,73)	(2,53)	(1,52)	(2,43)	(1,33)	(27,41)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,24)	(1,80)	(1,09)	(1,66)	(1,00)	(20,86)
Ausschüttungen	(0,48)	–	(0,43)	–	(0,44)	–
Schlussnettoinventarwert	8,21	12,49	7,27	12,06	6,53	125,59
Gesamtertrag	(12,72 %)	(12,60 %)	(12,59 %)	(12,10 %)	(12,84 %)	(14,24 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,73 %	0,62 %	0,60 %	0,11 %	1,30 %	1,34 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,42 %	5,61 %	5,92 %	6,19 %	4,79 %	4,91 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,98	13,70	8,85	13,08	8,15	141,69
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,47	0,69	0,44	0,73	0,33	6,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,05)	(0,10)	(0,07)	(0,09)	(0,03)	(1,49)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,42	0,59	0,37	0,64	0,30	4,76
Ausschüttungen	(0,47)	–	(0,43)	–	(0,48)	–
Schlussnettoinventarwert	9,93	14,29	8,79	13,72	7,97	146,45
Gesamtertrag	4,32 %	4,31 %	4,24 %	4,89 %	3,85 %	3,36 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,73 %	0,64 %	0,65 %	0,13 %	1,32 %	1,39 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,75 %	4,91 %	4,91 %	5,40 %	4,09 %	4,31 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD	Thesaurierende Klasse SGD A SGD	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,64	30,46	8,42	8,07	18,63	9,80
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,68	1,29	0,35	0,34	0,81	0,41
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,76)	(5,17)	(1,38)	(1,32)	(3,12)	(1,61)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,08)	(3,88)	(1,03)	(0,98)	(2,31)	(1,20)
Ausschüttungen	(0,91)	–	(0,46)	(0,44)	–	(0,40)
Schlussnettoinventarwert	13,65	26,58	6,93	6,65	16,32	8,20
Gesamtertrag	(12,73 %)	(12,74 %)	(12,45 %)	(12,35 %)	(12,40 %)	(12,37 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,27 %	1,27 %	1,31 %	1,30 %	1,31 %	1,31 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,65 %	4,65 %	4,76 %	4,87 %	4,79 %	4,76 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	17,02	29,34	8,61	8,25	17,94	9,83
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,68	1,22	0,34	0,33	0,75	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,05)	(0,10)	(0,02)	(0,02)	(0,06)	(0,02)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,63	1,12	0,32	0,31	0,69	0,38
Ausschüttungen	(1,01)	–	(0,51)	(0,49)	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	16,64	30,46	8,42	8,07	18,63	9,80
Gesamtertrag	3,82 %	3,82 %	3,84 %	3,85 %	3,85 %	3,90 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,32 %	1,32 %	1,31 %	1,32 %	1,32 %	1,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,07 %	4,08 %	4,05 %	4,07 %	4,07 %	4,07 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD B US\$	Thesaurierende Klasse USD C US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Ausschüttende Klasse USD C1 US\$	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,70	12,61	13,86	11,36	9,90	6,70
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,19	0,36	0,53	0,39	0,33	0,18
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,10)	(2,09)	(2,32)	(1,90)	(1,62)	(1,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,91)	(1,73)	(1,79)	(1,51)	(1,29)	(0,91)
Ausschüttungen	(0,41)	–	–	–	(0,32)	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	5,38	10,88	12,07	9,85	8,29	5,38
Gesamtertrag	(13,86 %)	(13,72 %)	(12,91 %)	(13,29 %)	(13,20 %)	(13,86 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,91 %	2,91 %	1,91 %	2,31 %	2,31 %	2,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,18 %	3,16 %	4,19 %	3,79 %	3,78 %	3,14 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,03	12,34	13,43	11,04	9,94	7,03
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,17	0,30	0,48	0,35	0,30	0,17
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,02)	(0,03)	(0,05)	(0,03)	(0,03)	(0,02)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,15	0,27	0,43	0,32	0,27	0,15
Ausschüttungen	(0,48)	–	–	–	(0,31)	(0,48)
Schlussnettoinventarwert	6,70	12,61	13,86	11,36	9,90	6,70
Gesamtertrag	2,23 %	2,19 %	3,20 %	2,90 %	2,76 %	2,23 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,92 %	2,91 %	1,93 %	2,33 %	2,33 %	2,92 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,45 %	2,43 %	3,48 %	3,09 %	3,07 %	2,46 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C2 US\$	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD E US\$	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,63	6,79	11,38	8,69	28,05	11,34
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,36	0,19	0,33	0,41	1,38	0,54
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,10)	(1,10)	(1,90)	(1,42)	(4,70)	(1,87)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,74)	(0,91)	(1,57)	(1,01)	(3,32)	(1,33)
Ausschüttungen	–	(0,42)	–	(0,48)	–	(0,53)
Schlussnettoinventarwert	10,89	5,46	9,81	7,20	24,73	9,48
Gesamtertrag	(13,78 %)	(13,73 %)	(13,80 %)	(11,86 %)	(11,84 %)	(11,90 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,91 %	2,91 %	2,91 %	0,71 %	0,70 %	0,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,18 %	3,18 %	3,18 %	5,38 %	5,42 %	5,31 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	12,35	7,13	11,13	8,84	26,84	11,37
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,30	0,17	0,28	0,40	1,29	0,53
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,02)	(0,02)	(0,03)	(0,02)	(0,08)	(0,02)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,28	0,15	0,25	0,38	1,21	0,51
Ausschüttungen	–	(0,49)	–	(0,53)	–	(0,54)
Schlussnettoinventarwert	12,63	6,79	11,38	8,69	28,05	11,34
Gesamtertrag	2,27 %	2,15 %	2,25 %	4,39 %	4,51 %	4,57 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,92 %	2,93 %	2,92 %	0,70 %	0,72 %	0,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,43 %	2,47 %	2,44 %	4,61 %	4,68 %	4,66 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,76	15,33	9,46	10,56	13,92	9,49
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,47	0,77	0,46	0,53	0,53	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,60)	(2,57)	(1,56)	(1,75)	(2,33)	(1,55)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,13)	(1,80)	(1,10)	(1,22)	(1,80)	(1,20)
Ausschüttungen	(0,54)	–	(0,45)	(0,46)	–	(0,50)
Schlussnettoinventarwert	8,09	13,53	7,91	8,88	12,12	7,79
Gesamtertrag	(11,82 %)	(11,74 %)	(11,79 %)	(11,71 %)	(12,93 %)	(12,84 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,61 %	0,61 %	0,60 %	0,47 %	1,91 %	1,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,50 %	5,47 %	5,62 %	5,65 %	4,20 %	4,19 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,90	14,65	9,49	10,53	13,48	9,71
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,47	0,72	0,45	0,52	0,48	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,02)	(0,04)	(0,02)	(0,03)	(0,04)	(0,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,45	0,68	0,43	0,49	0,44	0,31
Ausschüttungen	(0,59)	–	(0,46)	(0,46)	–	(0,53)
Schlussnettoinventarwert	9,76	15,33	9,46	10,56	13,92	9,49
Gesamtertrag	4,69 %	4,64 %	4,61 %	4,75 %	3,26 %	3,24 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,62 %	0,62 %	0,62 %	0,48 %	1,93 %	1,93 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,77 %	4,77 %	4,78 %	4,91 %	3,48 %	3,52 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD P US\$	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$	Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD T US\$	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD U US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,10	7,33	7,37	13,80	8,20	15,05
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,60	0,27	0,27	0,53	0,37	0,70
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,03)	(1,20)	(1,20)	(2,31)	(1,35)	(2,53)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,43)	(0,93)	(0,93)	(1,78)	(0,98)	(1,83)
Ausschüttungen	–	(0,45)	(0,45)	–	(0,45)	–
Schlussnettoinventarwert	10,67	5,95	5,99	12,02	6,77	13,22
Gesamtertrag	(11,82 %)	(12,92 %)	(12,83 %)	(12,90 %)	(12,17 %)	(12,16 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	1,91 %	1,91 %	1,91 %	1,00 %	1,01 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,37 %	4,20 %	4,19 %	4,20 %	5,11 %	5,09 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,58	7,61	7,66	13,37	8,35	14,44
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,56	0,26	0,26	0,47	0,36	0,65
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,04)	(0,02)	(0,02)	(0,04)	(0,01)	(0,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,52	0,24	0,24	0,43	0,35	0,61
Ausschüttungen	–	(0,52)	(0,53)	–	(0,50)	–
Schlussnettoinventarwert	12,10	7,33	7,37	13,80	8,20	15,05
Gesamtertrag	4,49 %	3,31 %	3,17 %	3,22 %	4,28 %	4,22 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	1,92 %	1,93 %	1,92 %	1,02 %	1,01 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,69 %	3,46 %	3,47 %	3,43 %	4,37 %	4,37 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,26	67,31	67,24	66,55	166,84	73,73
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,78	1,94	1,94	1,92	5,09	2,81
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,39)	(8,93)	(8,92)	(8,83)	(22,99)	(9,84)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,61)	(6,99)	(6,98)	(6,91)	(17,90)	(7,03)
Ausschüttungen	–	(6,56)	(6,55)	(6,49)	–	(7,22)
Schlussnettoinventarwert	12,65	53,76	53,71	53,15	148,94	59,48
Gesamtertrag	(11,29 %)	(10,73 %)	(10,72 %)	(10,73 %)	(10,73 %)	(9,83 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,11 %	3,02 %	3,02 %	3,02 %	3,02 %	1,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,98 %	3,26 %	3,20 %	3,23 %	3,21 %	4,33 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	13,57	70,61	70,54	69,81	155,94	76,58
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,73	1,83	1,87	1,84	4,31	2,81
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,04)	2,82	2,78	2,76	6,59	3,01
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,69	4,65	4,65	4,60	10,90	5,82
Ausschüttungen	–	(7,95)	(7,95)	(7,86)	–	(8,67)
Schlussnettoinventarwert	14,26	67,31	67,24	66,55	166,84	73,73
Gesamtertrag	5,08 %	6,98 %	6,98 %	6,98 %	6,99 %	8,05 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,11 %	3,16 %	3,17 %	3,16 %	3,16 %	2,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,26 %	2,66 %	2,69 %	2,68 %	2,67 %	3,74 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	152,51
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	6,16
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(21,15)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(14,99)
Schlussnettoinventarwert	137,52
Gesamtertrag	(9,83 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,34 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	141,13
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	5,44
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	5,94
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	11,38
Schlussnettoinventarwert	152,51
Gesamtertrag	8,06 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,07 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,71 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse CHF I4 CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I4 €	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR X €	Thesaurierende Klasse SGD A SGD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,86	10,82	10,88	11,94	10,83	21,75
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,03	(0,05)	0,04	(0,13)	(0,03)	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(4,50)	(4,45)	(4,50)	(4,23)	(4,47)	(8,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,47)	(4,50)	(4,46)	(4,36)	(4,50)	(8,78)
Schlussnettoinventarwert	6,39	6,32	6,42	7,58	6,33	12,97
Gesamtertrag	(41,16 %)	(41,59 %)	(40,99 %)	(36,52 %)	(41,55 %)	(40,37 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,70 %	1,89 %	0,72 %	2,67 %	1,64 %	1,86 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,45 %	(0,68 %)	0,51 %	(1,46 %)	(0,43 %)	(0,65 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	20,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,06)	(0,12)	(0,07)	(0,09)	(0,10)	(0,22)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,92	0,94	0,95	2,03	0,93	1,97
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,86	0,82	0,88	1,94	0,83	1,75
Schlussnettoinventarwert	10,86	10,82	10,88	11,94	10,83	21,75
Gesamtertrag	8,60 %	8,20 %	8,80 %	19,40 %	8,30 %	8,75 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,67 %	2,95 %	1,77 %	3,81 %	2,62 %	2,88 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,04 %)	(2,30 %)	(1,14 %)	(3,35 %)	(1,92 %)	(2,15 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SGD I4 SGD	Thesaurierende Klasse SGD X SGD	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I4 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	21,88	21,78	10,90	10,95	10,97	10,51
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,08	(0,06)	(0,05)	0,03	0,04	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(8,76)	(8,70)	(4,30)	(4,34)	(4,34)	(4,15)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(8,68)	(8,76)	(4,35)	(4,31)	(4,30)	(4,25)
Schlussnettoinventarwert	13,20	13,02	6,55	6,64	6,67	6,26
Gesamtertrag	(39,67 %)	(40,22 %)	(39,91 %)	(39,36 %)	(39,20 %)	(40,44 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,71 %	1,62 %	1,92 %	1,07 %	0,73 %	2,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,51 %	(0,40 %)	(0,70 %)	0,35 %	0,49 %	(1,45 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	20,00	20,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,15)	(0,21)	(0,31)	(0,07)	(0,07)	(0,07)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	2,03	1,99	1,21	1,02	1,04	0,58
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,88	1,78	0,90	0,95	0,97	0,51
Schlussnettoinventarwert	21,88	21,78	10,90	10,95	10,97	10,51
Gesamtertrag	9,40 %	8,90 %	9,00 %	9,50 %	9,70 %	5,10 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,88 %	2,64 %	5,03 %	2,04 %	1,79 %	3,85 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,21 %)	(1,98 %)	(4,16 %)	(1,31 %)	(1,17 %)	(3,42 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD X US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,92
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,03)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(4,31)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,34)
Schlussnettoinventarwert	6,58
Gesamtertrag	(39,74 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,37 %)
<b>31. Dezember 2021</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,02
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,92
Schlussnettoinventarwert	10,92
Gesamtertrag	9,20 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,93 %)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement<sup>1</sup>

	Ausschüttende Klasse EUR 15* €	Thesaurierende Klasse GBP 15 £	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse JPY I ¥	Ausschüttende Klasse JPY I ¥	Thesaurierende Klasse JPY 15 ¥
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	9,34	9,39	1.688,22	1.688,38	10.883,95
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,12	0,09	0,06	11,01	10,33	130,14
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,66)	(1,30)	(1,56)	(249,15)	(248,65)	(1.633,23)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,54)	(1,21)	(1,50)	(238,14)	(238,32)	(1.503,09)
Schlussnettoinventarwert	9,46	8,13	7,89	1.450,08	1.450,06	9.380,86
Gesamtertrag	(5,40 %)	(12,96 %)	(15,97 %)	(14,18 %)	(14,18 %)	(13,81 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,56 %	0,60 %	1,00 %	1,02 %	1,00 %	0,60 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,41 %	1,12 %	0,78 %	0,73 %	0,69 %	1,34 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	10,00	10,00	1.484,28	1.484,28	1.000,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	(0,02)	(0,02)	(21,47)	1,71	16,08
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	(0,64)	(0,59)	225,41	202,39	9.867,87
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(0,66)	(0,61)	203,94	204,10	9.883,95
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	–	9,34	9,39	1.688,22	1.688,38	10.883,95
Gesamtertrag	–	(6,60 %)	(6,10 %)	13,83 %	13,83 %	8,84 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	0,02 %	0,02 %	1,87 %	1,45 %	0,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	(0,01 %)	(0,01 %)	(1,25 %)	0,10 %	0,17 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement<sup>1</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse JPY Z ¥
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	1.065,69
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	19,75
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(163,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(143,26)
Schlussnettoinventarwert	922,43
Gesamtertrag	(13,44 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,34 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,06 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	1.000,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	2,50
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	63,19
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	65,69
Schlussnettoinventarwert	1.065,69
Gesamtertrag	6,57 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,35 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse SEK I SEK	Ausschüttende Klasse SEK I SEK	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,47	9,73	95,49	98,77	9,71	9,84
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,01	0,07	0,07	0,17	0,01	0,07
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,25)	(0,09)	(1,92)	(1,97)	(0,06)	(0,07)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,24)	(0,02)	(1,85)	(1,80)	(0,05)	0,00
Ausschüttungen	–	–	–	(0,08)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,23	9,71	93,64	96,89	9,66	9,84
Gesamtertrag	(2,53 %)	(0,21 %)	(1,94 %)	(1,83 %)	(0,51 %)	0,00 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,82 %	0,22 %	0,85 %	0,85 %	0,82 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,13 %	0,72 %	0,08 %	0,17 %	0,10 %	0,66 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,70	9,84	97,37	100,00	9,87	9,93
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,04	0,11	0,38	0,35	0,06	0,11
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,27)	(0,22)	(2,26)	(1,50)	(0,22)	(0,20)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,23)	(0,11)	(1,88)	(1,15)	(0,16)	(0,09)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,08)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,47	9,73	95,49	98,77	9,71	9,84
Gesamtertrag	(2,37 %)	(1,12 %)	(1,93 %)	(1,23 %)	(1,62 %)	(0,91 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,96 %	0,20 %	0,87 %	1,10 %	0,78 %	0,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,39 %	1,14 %	0,40 %	0,39 %	0,59 %	1,07 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Multi-Asset Income

	Ausschüttende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	11,79	11,40	13,15	10,51	11,56
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,24	0,21	0,10	0,31	0,25	0,12
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,48)	(1,68)	(1,61)	(1,87)	(1,46)	(1,64)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,24)	(1,47)	(1,51)	(1,56)	(1,21)	(1,52)
Ausschüttungen	(0,55)	–	–	–	(0,58)	–
Schlussnettoinventarwert	8,21	10,32	9,89	11,59	8,72	10,04
Gesamtertrag	(12,68 %)	(12,47 %)	(13,25 %)	(11,86 %)	(11,76 %)	(13,15 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,86 %	1,52 %	2,52 %	0,87 %	0,87 %	2,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,71 %	1,98 %	0,97 %	2,55 %	2,62 %	1,16 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,93	11,05	10,80	12,25	10,42	10,93
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,25	0,21	0,10	0,32	0,26	0,12
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,43	0,53	0,50	0,58	0,47	0,51
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,68	0,74	0,60	0,90	0,73	0,63
Ausschüttungen	(0,61)	–	–	–	(0,64)	–
Schlussnettoinventarwert	10,00	11,79	11,40	13,15	10,51	11,56
Gesamtertrag	7,13 %	6,70 %	5,56 %	7,35 %	7,30 %	5,76 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,90 %	1,57 %	2,57 %	0,93 %	0,91 %	2,37 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,56 %	1,82 %	0,86 %	2,54 %	2,45 %	1,05 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,56	11,60	17,08	20,33	17,91	19,54
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,14)	(0,02)	(0,03)	(0,32)	(0,15)	(0,33)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(4,80)	(3,37)	(3,62)	(4,29)	(4,66)	(5,05)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,94)	(3,39)	(3,65)	(4,61)	(4,81)	(5,38)
Schlussnettoinventarwert	11,62	8,21	13,43	15,72	13,10	14,16
Gesamtertrag	(29,83 %)	(29,22 %)	(21,37 %)	(22,68 %)	(26,86 %)	(27,53 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,86 %	1,02 %	1,03 %	2,65 %	1,90 %	2,89 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,05 %)	(0,21 %)	(0,20 %)	(1,82 %)	(1,05 %)	(2,09 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	13,62	10,00	12,80	15,49	14,57	16,06
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,22)	(0,06)	(0,08)	(0,41)	(0,23)	(0,43)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,16	1,66	4,36	5,25	3,57	3,91
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,94	1,60	4,28	4,84	3,34	3,48
Schlussnettoinventarwert	16,56	11,60	17,08	20,33	17,91	19,54
Gesamtertrag	21,59 %	16,00 %	33,44 %	31,25 %	22,92 %	21,67 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,05 %	1,15 %	1,15 %	2,88 %	1,97 %	2,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,48 %)	(0,56 %)	(0,56 %)	(2,29 %)	(1,40 %)	(2,41 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Next Generation Mobility (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD X US\$
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	17,96	17,94	19,64	21,13
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,04)	(0,03)	(0,29)	(0,15)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(4,67)	(4,67)	(5,10)	(5,50)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,71)	(4,70)	(5,39)	(5,65)
Schlussnettoinventarwert	13,25	13,24	14,25	15,48
Gesamtertrag	(26,22 %)	(26,20 %)	(27,44 %)	(26,74 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,04 %	1,05 %	2,69 %	1,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,25 %)	(0,21 %)	(1,85 %)	(0,90 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	14,48	14,47	16,11	17,16
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,09)	(0,10)	(0,39)	(0,24)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,57	3,57	3,92	4,21
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,48	3,47	3,53	3,97
Schlussnettoinventarwert	17,96	17,94	19,64	21,13
Gesamtertrag	24,03 %	23,98 %	21,91 %	23,14 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,12 %	1,15 %	2,76 %	1,80 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,55 %)	(0,59 %)	(2,19 %)	(1,23 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy2

	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* €	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* €	Thesaurierende Klasse USD I* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,05	(0,08)	0,02
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,54)	(0,53)	(0,41)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,49)	(0,61)	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	9,51	9,39	9,61
Gesamtertrag	(4,90 %)	(6,10 %)	(3,90 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>			
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	2,50 %	0,96 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,86 %	(1,15 %)	0,43 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) CAD	Thesaurierende Klasse CHF A CHF	Ausschüttende Klasse CHF A CHF	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Ausschüttende Klasse CHF I CHF
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,04	9,33	10,23	7,79	10,63	7,82
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,27	0,28	0,30	0,22	0,35	0,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,01)	(1,00)	(1,30)	(0,97)	(1,34)	(0,97)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,74)	(0,72)	(1,00)	(0,75)	(0,99)	(0,72)
Ausschüttungen	(0,39)	(0,40)	–	(0,24)	–	(0,28)
Schlussnettoinventarwert	7,91	8,21	9,23	6,80	9,64	6,82
Gesamtertrag	(8,23 %)	(7,71 %)	(9,78 %)	(9,73 %)	(9,31 %)	(9,35 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,10 %	1,12 %	1,05 %	1,05 %	0,56 %	0,56 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,29 %	3,35 %	3,11 %	3,11 %	3,59 %	3,58 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,53	9,82	10,39	8,17	10,74	8,20
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,30	0,30	0,32	0,25	0,39	0,29
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,37)	(0,36)	(0,48)	(0,37)	(0,50)	(0,37)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,07)	(0,06)	(0,16)	(0,12)	(0,11)	(0,08)
Ausschüttungen	(0,42)	(0,43)	–	(0,26)	–	(0,30)
Schlussnettoinventarwert	9,04	9,33	10,23	7,79	10,63	7,82
Gesamtertrag	(0,77 %)	(0,61 %)	(1,54 %)	(1,54 %)	(1,02 %)	(1,02 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,12 %	1,09 %	1,09 %	1,09 %	0,59 %	0,60 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,20 %	3,12 %	3,08 %	3,08 %	3,58 %	3,53 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse CHF I2 CHF	Ausschüttende Klasse CHF I2 CHF	Thesaurierende Klasse CHF I5 CHF	Thesaurierende Klasse CHF P CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR A €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,84	8,58	11,03	10,27	10,55	8,05
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,36	0,29	0,40	0,35	0,31	0,23
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,36)	(1,07)	(1,41)	(1,30)	(1,31)	(0,99)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,00)	(0,78)	(1,01)	(0,95)	(1,00)	(0,76)
Ausschüttungen	–	(0,31)	–	–	–	(0,25)
Schlussnettoinventarwert	9,84	7,49	10,02	9,32	9,55	7,04
Gesamtertrag	(9,23 %)	(9,17 %)	(9,16 %)	(9,25 %)	(9,48 %)	(9,51 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,47 %	0,47 %	0,32 %	0,54 %	1,06 %	1,06 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,71 %	3,69 %	3,83 %	3,62 %	3,16 %	3,16 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,94	9,00	11,12	10,38	10,70	8,42
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,40	0,32	0,43	0,38	0,34	0,27
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,50)	(0,40)	(0,52)	(0,49)	(0,49)	(0,38)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,10)	(0,08)	(0,09)	(0,11)	(0,15)	(0,11)
Ausschüttungen	–	(0,34)	–	–	–	(0,26)
Schlussnettoinventarwert	10,84	8,58	11,03	10,27	10,55	8,05
Gesamtertrag	(0,91 %)	(0,96 %)	(0,81 %)	(1,06 %)	(1,40 %)	(1,30 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,49 %	0,49 %	0,34 %	0,56 %	1,13 %	1,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,68 %	3,68 %	3,83 %	3,61 %	3,21 %	3,22 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,97	8,05	11,05	8,72	11,44	10,36
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,38	0,27	0,38	0,28	0,42	0,25
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,37)	(0,98)	(1,37)	(1,05)	(1,43)	(1,28)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,99)	(0,71)	(0,99)	(0,77)	(1,01)	(1,03)
Ausschüttungen	–	(0,29)	–	(0,32)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,98	7,05	10,06	7,63	10,43	9,33
Gesamtertrag	(9,02 %)	(8,91 %)	(8,96 %)	(8,89 %)	(8,83 %)	(9,94 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,57 %	0,57 %	0,47 %	0,47 %	0,33 %	1,65 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,66 %	3,66 %	3,74 %	3,74 %	3,92 %	2,57 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,07	8,43	11,13	9,13	11,51	10,57
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,41	0,31	0,43	0,36	0,46	0,27
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,51)	(0,38)	(0,51)	(0,43)	(0,53)	(0,48)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,10)	(0,07)	(0,08)	(0,07)	(0,07)	(0,21)
Ausschüttungen	–	(0,31)	–	(0,34)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,97	8,05	11,05	8,72	11,44	10,36
Gesamtertrag	(0,90 %)	(0,92 %)	(0,72 %)	(0,80 %)	(0,61 %)	(1,99 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,61 %	0,61 %	0,51 %	0,52 %	0,35 %	1,77 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,74 %	3,74 %	3,84 %	3,79 %	3,99 %	2,58 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR P €	Thesaurierende Klasse EUR U €	Ausschüttende Klasse EUR X €	Thesaurierende Klasse GBP A £	Thesaurierende Klasse GBP I £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,89	10,51	10,45	10,06	10,87	11,14
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,18	0,36	0,33	0,34	0,34	0,40
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,95)	(1,31)	(1,29)	(1,23)	(1,21)	(1,24)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,77)	(0,95)	(0,96)	(0,89)	(0,87)	(0,84)
Ausschüttungen	(0,33)	–	–	(0,37)	–	–
Schlussnettoinventarwert	6,79	9,56	9,49	8,80	10,00	10,30
Gesamtertrag	(9,94 %)	(9,04 %)	(9,19 %)	(8,92 %)	(8,00 %)	(7,54 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,65 %	0,55 %	0,82 %	0,47 %	1,11 %	0,59 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,57 %	3,68 %	3,41 %	3,75 %	3,29 %	3,81 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,40	10,60	10,57	10,53	10,95	11,16
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,21	0,40	0,37	0,40	0,35	0,41
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,37)	(0,49)	(0,49)	(0,48)	(0,43)	(0,43)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,16)	(0,09)	(0,12)	(0,08)	(0,08)	(0,02)
Ausschüttungen	(0,35)	–	–	(0,39)	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,89	10,51	10,45	10,06	10,87	11,14
Gesamtertrag	(1,93 %)	(0,85 %)	(1,14 %)	(0,77 %)	(0,73 %)	(0,18 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,77 %	0,59 %	0,87 %	0,51 %	1,11 %	0,60 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,58 %	3,76 %	3,49 %	3,84 %	3,14 %	3,65 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I5 £	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse JPY I ¥
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,34	11,12	9,17	8,62	10,45	1.126,55
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,33	0,41	0,33	0,32	0,37	39,33
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,03)	(1,24)	(1,01)	(0,95)	(1,15)	(141,72)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,70)	(0,83)	(0,68)	(0,63)	(0,78)	(102,39)
Ausschüttungen	(0,34)	–	(0,34)	(0,33)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,30	10,29	8,15	7,66	9,67	1.024,16
Gesamtertrag	(7,54 %)	(7,46 %)	(7,43 %)	(7,29 %)	(7,46 %)	(9,09 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,59 %	0,49 %	0,49 %	0,34 %	0,57 %	0,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,81 %	3,92 %	3,90 %	4,05 %	3,80 %	3,72 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,71	11,13	9,54	8,96	10,48	1.131,21
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,35	0,42	0,35	0,34	0,39	42,87
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,37)	(0,43)	(0,37)	(0,33)	(0,42)	(47,53)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,02)	(0,01)	(0,02)	0,01	(0,03)	(4,66)
Ausschüttungen	(0,35)	–	(0,35)	(0,35)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,34	11,12	9,17	8,62	10,45	1.126,55
Gesamtertrag	(0,22 %)	(0,09 %)	(0,19 %)	0,05 %	(0,29 %)	(0,41 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,60 %	0,50 %	0,49 %	0,34 %	0,57 %	0,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,65 %	3,75 %	3,75 %	3,90 %	3,68 %	3,77 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse JPY I ¥	Thesaurierende Klasse SEK A SEK	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	824,34	102,60	18,32	9,29	12,21	9,07
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	28,93	3,21	0,52	0,27	0,37	0,27
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(103,03)	(12,54)	(1,92)	(0,97)	(1,29)	(0,95)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(74,10)	(9,33)	(1,40)	(0,70)	(0,92)	(0,68)
Ausschüttungen	(30,29)	–	(0,79)	(0,40)	–	(0,28)
Schlussnettoinventarwert	719,95	93,27	16,13	8,19	11,29	8,11
Gesamtertrag	(9,09 %)	(9,09 %)	(7,66 %)	(7,54 %)	(7,53 %)	(7,55 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,58 %	1,11 %	1,05 %	1,08 %	1,08 %	1,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,70 %	3,31 %	3,12 %	3,22 %	3,22 %	3,21 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	859,14	103,67	19,26	9,77	12,28	9,41
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	31,75	3,39	0,59	0,30	0,38	0,29
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(35,02)	(4,46)	(0,68)	(0,35)	(0,45)	(0,34)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,27)	(1,07)	(0,09)	(0,05)	(0,07)	(0,05)
Ausschüttungen	(31,53)	–	(0,85)	(0,43)	–	(0,29)
Schlussnettoinventarwert	824,34	102,60	18,32	9,29	12,21	9,07
Gesamtertrag	(0,41 %)	(1,03 %)	(0,50 %)	(0,53 %)	(0,57 %)	(0,52 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,62 %	1,15 %	1,09 %	1,09 %	1,09 %	1,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,77 %	3,27 %	3,11 %	3,10 %	3,10 %	3,10 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Ausschüttende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I2 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,62	9,58	12,69	9,64	12,45	9,63
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,22	0,19	0,44	0,33	0,44	0,34
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,12)	(1,00)	(1,34)	(1,01)	(1,31)	(1,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,90)	(0,81)	(0,90)	(0,68)	(0,87)	(0,67)
Ausschüttungen	–	(0,20)	–	(0,34)	–	(0,35)
Schlussnettoinventarwert	9,72	8,57	11,79	8,62	11,58	8,61
Gesamtertrag	(8,47 %)	(8,45 %)	(7,09 %)	(7,07 %)	(6,99 %)	(6,99 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,08 %	2,08 %	0,58 %	0,58 %	0,48 %	0,48 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,22 %	2,21 %	3,72 %	3,72 %	3,82 %	3,81 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,79	9,94	12,69	10,00	12,44	9,99
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,22	0,20	0,46	0,35	0,46	0,36
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,39)	(0,35)	(0,46)	(0,35)	(0,45)	(0,35)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,17)	(0,15)	0,00	0,00	0,01	0,01
Ausschüttungen	–	(0,21)	–	(0,36)	–	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	10,62	9,58	12,69	9,64	12,45	9,63
Gesamtertrag	(1,58 %)	(1,53 %)	0,00 %	(0,01 %)	0,08 %	0,09 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,10 %	2,10 %	0,59 %	0,59 %	0,49 %	0,49 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,08 %	2,09 %	3,60 %	3,60 %	3,70 %	3,69 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5 US\$	Ausschüttende Klasse USD I5 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD P US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,86	9,23	10,82	8,92	12,29	13,04
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,48	0,33	0,26	0,21	0,43	0,52
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,36)	(0,96)	(1,14)	(0,93)	(1,30)	(1,38)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,88)	(0,63)	(0,88)	(0,72)	(0,87)	(0,86)
Ausschüttungen	–	(0,35)	–	(0,36)	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,98	8,25	9,94	7,84	11,42	12,18
Gesamtertrag	(6,84 %)	(6,87 %)	(8,13 %)	(8,11 %)	(7,08 %)	(6,60 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,33 %	0,33 %	1,68 %	1,68 %	0,56 %	0,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,97 %	3,96 %	2,61 %	2,61 %	3,74 %	4,23 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,83	9,57	10,94	9,41	12,29	12,98
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,50	0,36	0,27	0,23	0,45	0,54
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,47)	(0,33)	(0,39)	(0,33)	(0,45)	(0,48)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,03	0,03	(0,12)	(0,10)	0,00	0,06
Ausschüttungen	–	(0,37)	–	(0,39)	–	–
Schlussnettoinventarwert	12,86	9,23	10,82	8,92	12,29	13,04
Gesamtertrag	0,23 %	0,29 %	(1,10 %)	(1,06 %)	0,00 %	0,46 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,34 %	0,33 %	1,70 %	1,70 %	0,56 %	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,85 %	3,85 %	2,49 %	2,49 %	3,63 %	4,10 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse CHF A CHF	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) CNY	Thesaurierende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR A €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,96	11,58	12,47	94,05	12,13	7,61
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,34	0,49	0,60	4,15	0,52	0,32
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,80)	(1,32)	(1,43)	(7,92)	(1,36)	(0,85)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,46)	(0,83)	(0,83)	(3,77)	(0,84)	(0,53)
Ausschüttungen	(0,42)	–	–	(6,03)	–	(0,32)
Schlussnettoinventarwert	7,08	10,75	11,64	84,25	11,29	6,76
Gesamtertrag	(5,86 %)	(7,17 %)	(6,66 %)	(4,07 %)	(6,92 %)	(7,02 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,34 %	1,27 %	0,69 %	1,36 %	1,30 %	1,30 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,71 %	4,45 %	5,03 %	4,73 %	4,51 %	4,52 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	8,17	11,33	12,12	94,90	11,84	7,75
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,35	0,47	0,58	3,86	0,52	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,11)	(0,22)	(0,23)	1,60	(0,23)	(0,14)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,24	0,25	0,35	5,46	0,29	0,19
Ausschüttungen	(0,45)	–	–	(6,31)	–	(0,33)
Schlussnettoinventarwert	7,96	11,58	12,47	94,05	12,13	7,61
Gesamtertrag	2,94 %	2,21 %	2,89 %	5,95 %	2,45 %	2,54 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,37 %	1,33 %	0,74 %	1,31 %	1,38 %	1,39 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,27 %	4,13 %	4,73 %	4,09 %	4,30 %	4,30 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Ausschüttende Klasse GBP I £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,85	11,90	10,82	7,85	13,86	8,37
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,63	0,62	0,41	0,28	0,71	0,43
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,45)	(1,37)	(1,22)	(0,86)	(1,39)	(0,85)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,82)	(0,75)	(0,81)	(0,58)	(0,68)	(0,42)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,44)	–	(0,42)
Schlussnettoinventarwert	12,03	11,15	10,01	6,83	13,18	7,53
Gesamtertrag	(6,38 %)	(6,30 %)	(7,49 %)	(7,54 %)	(4,91 %)	(5,06 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,71 %	0,61 %	1,89 %	1,89 %	0,73 %	0,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,10 %	5,27 %	3,92 %	3,93 %	5,31 %	5,25 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,47	11,53	10,63	8,15	13,37	8,46
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,62	0,59	0,40	0,29	0,66	0,40
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,24)	(0,22)	(0,21)	(0,14)	(0,17)	(0,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,38	0,37	0,19	0,15	0,49	0,31
Ausschüttungen	–	–	–	(0,45)	–	(0,40)
Schlussnettoinventarwert	12,85	11,90	10,82	7,85	13,86	8,37
Gesamtertrag	3,05 %	3,21 %	1,79 %	1,84 %	3,66 %	3,76 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,75 %	0,66 %	2,02 %	2,02 %	0,74 %	0,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,92 %	5,03 %	3,67 %	3,67 %	4,81 %	4,81 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* HKD	Thesaurierende Klasse JPY I ¥	Ausschüttende Klasse JPY I* ¥	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,86	8,15	10,00	1.288,30	1.000,00	16,57
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,67	0,42	0,13	64,55	10,05	0,69
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,29)	(0,82)	(0,04)	(147,17)	4,64	(1,52)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,62)	(0,40)	0,09	(82,62)	14,69	(0,83)
Ausschüttungen	–	(0,41)	(0,12)	–	–	(0,88)
Schlussnettoinventarwert	12,24	7,34	9,97	1.205,68	1.014,69	14,86
Gesamtertrag	(4,82 %)	(4,88 %)	0,93 %	(6,41 %)	1,47 %	(5,08 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,63 %	0,63 %	1,29 %	0,72 %	0,66 %	1,28 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,41 %	5,36 %	4,66 %	5,20 %	4,93 %	4,49 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,39	8,24	–	1.244,42	–	16,95
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,62	0,40	–	63,33	–	0,70
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,15)	(0,09)	–	(19,45)	–	(0,16)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,47	0,31	–	43,88	–	0,54
Ausschüttungen	–	(0,40)	–	–	–	(0,92)
Schlussnettoinventarwert	12,86	8,15	–	1.288,30	–	16,57
Gesamtertrag	3,79 %	3,85 %	–	3,53 %	–	3,29 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,64 %	0,64 %	–	0,77 %	–	1,33 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,91 %	4,91 %	–	4,97 %	–	4,15 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,41	13,77	8,70	10,89	14,61	8,87
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,36	0,61	0,37	0,37	0,73	0,43
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,75)	(1,27)	(0,79)	(1,00)	(1,34)	(0,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,39)	(0,66)	(0,42)	(0,63)	(0,61)	(0,37)
Ausschüttungen	(0,45)	–	(0,37)	–	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	7,57	13,11	7,91	10,26	14,00	8,09
Gesamtertrag	(4,73 %)	(4,79 %)	(4,83 %)	(5,79 %)	(4,18 %)	(4,15 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,32 %	1,32 %	1,32 %	2,32 %	0,71 %	0,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,58 %	4,59 %	4,60 %	3,60 %	5,20 %	5,08 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	8,60	13,33	8,78	10,65	14,06	8,98
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,35	0,56	0,36	0,34	0,68	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,07)	(0,12)	(0,07)	(0,10)	(0,13)	(0,08)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,28	0,44	0,29	0,24	0,55	0,34
Ausschüttungen	(0,47)	–	(0,37)	–	–	(0,45)
Schlussnettoinventarwert	8,41	13,77	8,70	10,89	14,61	8,87
Gesamtertrag	3,33 %	3,30 %	3,32 %	2,25 %	3,91 %	3,84 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,32 %	1,33 %	1,33 %	2,34 %	0,73 %	0,73 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,13 %	4,14 %	4,14 %	3,13 %	4,74 %	4,74 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Ausschüttende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD I5* US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,68	8,69	10,00	11,15	8,97	13,12
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,70	0,43	0,17	0,43	0,34	0,74
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,27)	(0,79)	(0,13)	(1,03)	(0,82)	(1,22)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,57)	(0,36)	0,04	(0,60)	(0,48)	(0,48)
Ausschüttungen	–	(0,43)	–	–	(0,49)	–
Schlussnettoinventarwert	13,11	7,90	10,04	10,55	8,00	12,64
Gesamtertrag	(4,17 %)	(4,15 %)	0,40 %	(5,38 %)	(5,37 %)	(3,66 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,62 %	0,62 %	0,40 %	1,91 %	1,91 %	0,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,30 %	5,30 %	5,60 %	4,02 %	4,03 %	5,80 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,15	8,77	–	10,86	9,24	12,55
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,65	0,42	–	0,39	0,32	0,69
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,12)	(0,07)	–	(0,10)	(0,08)	(0,12)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,53	0,35	–	0,29	0,24	0,57
Ausschüttungen	–	(0,43)	–	–	(0,51)	–
Schlussnettoinventarwert	13,68	8,69	–	11,15	8,97	13,12
Gesamtertrag	4,03 %	4,04 %	–	2,67 %	2,61 %	4,54 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,62 %	0,63 %	–	1,94 %	1,94 %	0,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,83 %	4,84 %	–	3,53 %	3,53 %	5,34 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) €	Thesaurierende Klasse EUR A* €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR M €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,56	10,22	9,04	10,00	12,18	11,36
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,22	0,34	0,20	0,04	0,34	0,19
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,31)	(1,43)	(1,33)	0,01	(1,84)	(1,70)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,09)	(1,09)	(1,13)	0,05	(1,50)	(1,51)
Ausschüttungen	(0,37)	(0,39)	(0,35)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,10	8,74	7,56	10,05	10,68	9,85
Gesamtertrag	(11,58 %)	(10,76 %)	(12,73 %)	0,50 %	(12,32 %)	(13,29 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,15 %	0,13 %	1,10 %	1,16 %	0,61 %	1,69 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,56 %	3,79 %	2,46 %	2,93 %	3,01 %	1,84 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,77	10,34	9,30	–	11,97	11,28
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,25	0,36	0,24	–	0,37	0,22
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,07)	(0,07)	(0,13)	–	(0,16)	(0,14)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,18	0,29	0,11	–	0,21	0,08
Ausschüttungen	(0,39)	(0,41)	(0,37)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,56	10,22	9,04	–	12,18	11,36
Gesamtertrag	1,85 %	2,88 %	1,18 %	–	1,75 %	0,71 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,17 %	0,13 %	1,18 %	–	0,66 %	1,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,55 %	3,48 %	2,62 %	–	3,10 %	1,97 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) £	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) HKD	Thesaurierende Klasse JPY I ¥	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) ¥	Ausschüttende Klasse JPY I CG ¥	Ausschüttende Klasse JPY I ¥
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,36	9,76	1.216,93	1.610,18	1.001,03	944,76
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,22	0,22	33,92	52,06	28,06	26,03
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,27)	(1,29)	(185,28)	(5,42)	(152,44)	(142,34)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,05)	(1,07)	(151,36)	46,64	(124,38)	(116,31)
Ausschüttungen	(0,36)	(0,38)	–	–	(1,03)	(25,15)
Schlussnettoinventarwert	7,95	8,31	1.065,57	1.656,82	875,62	803,30
Gesamtertrag	(11,37 %)	(11,15 %)	(12,44 %)	2,90 %	(12,44 %)	(12,44 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,15 %	1,12 %	0,62 %	0,62 %	0,62 %	0,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,53 %	2,44 %	2,98 %	3,06 %	3,03 %	3,02 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,56	9,95	1.189,95	1.406,02	1.061,30	955,90
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,24	0,24	37,76	47,83	31,75	30,01
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,06)	(0,03)	(10,78)	156,33	(9,07)	(8,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,18	0,21	26,98	204,16	22,68	21,33
Ausschüttungen	(0,38)	(0,40)	–	–	(82,95)	(32,47)
Schlussnettoinventarwert	9,36	9,76	1.216,93	1.610,18	1.001,03	944,76
Gesamtertrag	1,91 %	2,10 %	2,27 %	14,52 %	2,27 %	2,27 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,15 %	1,13 %	0,67 %	0,67 %	0,67 %	0,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,54 %	2,46 %	3,13 %	3,15 %	3,16 %	3,16 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse JPY Z* ¥	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD	Thesaurierende Klasse SGD A SGD	Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) SGD	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	1.000,00	18,64	22,86	20,62	9,47	12,72
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	25,82	0,41	0,51	0,56	0,22	0,30
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(110,39)	(2,43)	(3,01)	(2,69)	(1,22)	(1,65)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(84,57)	(2,02)	(2,50)	(2,13)	(1,00)	(1,35)
Ausschüttungen	–	(0,72)	–	(0,80)	(0,36)	–
Schlussnettoinventarwert	915,43	15,90	20,36	17,69	8,11	11,37
Gesamtertrag	(8,46 %)	(10,99 %)	(10,94 %)	(10,48 %)	(10,63 %)	(10,61 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,12 %	1,09 %	1,09 %	0,61 %	1,12 %	1,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,63 %	2,44 %	2,40 %	3,03 %	2,51 %	2,56 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	–	18,99	22,39	20,91	9,65	12,45
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	0,47	0,55	0,61	0,24	0,31
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	(0,07)	(0,08)	(0,07)	(0,04)	(0,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	0,40	0,47	0,54	0,20	0,27
Ausschüttungen	–	(0,75)	–	(0,83)	(0,38)	–
Schlussnettoinventarwert	–	18,64	22,86	20,62	9,47	12,72
Gesamtertrag	–	2,17 %	2,10 %	2,64 %	2,14 %	2,17 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	–	1,14 %	1,13 %	0,64 %	1,13 %	1,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	2,49 %	2,44 %	2,96 %	2,47 %	2,48 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,75	11,29	13,67	10,80	12,79	9,69
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,25	0,16	0,39	0,30	0,23	0,17
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,38)	(1,46)	(1,79)	(1,39)	(1,66)	(1,24)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,13)	(1,30)	(1,40)	(1,09)	(1,43)	(1,07)
Ausschüttungen	(0,23)	–	–	(0,28)	–	(0,32)
Schlussnettoinventarwert	9,39	9,99	12,27	9,43	11,36	8,30
Gesamtertrag	(10,62 %)	(11,51 %)	(10,24 %)	(10,19 %)	(11,18 %)	(11,16 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,12 %	2,12 %	0,62 %	0,62 %	1,72 %	1,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,56 %	1,49 %	3,05 %	3,07 %	1,95 %	1,96 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,83	11,17	13,31	10,88	12,59	9,94
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,26	0,17	0,40	0,32	0,24	0,18
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,03)	(0,05)	(0,04)	(0,04)	(0,04)	(0,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,23	0,12	0,36	0,28	0,20	0,15
Ausschüttungen	(0,31)	–	–	(0,36)	–	(0,40)
Schlussnettoinventarwert	10,75	11,29	13,67	10,80	12,79	9,69
Gesamtertrag	2,14 %	1,07 %	2,70 %	2,65 %	1,59 %	1,55 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,13 %	2,14 %	0,63 %	0,63 %	1,74 %	1,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,42 %	1,49 %	2,98 %	2,97 %	1,87 %	1,84 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	13,72
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,45
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,78)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,33)
Schlussnettoinventarwert	12,39
Gesamtertrag	(9,69 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,55 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	13,30
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,47
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,05)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,42
Schlussnettoinventarwert	13,72
Gesamtertrag	3,16 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,50 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR X* €	Thesaurierende Klasse GBP X* £	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	9,90	9,90	9,90	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,38	0,32	0,33	0,34	0,40	0,41
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,87)	(1,01)	(1,99)	(1,96)	(1,96)	(1,71)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,49)	(0,69)	(1,66)	(1,62)	(1,56)	(1,30)
Ausschüttungen	–	–	(0,61)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,51	9,31	7,63	8,28	8,34	8,70
Gesamtertrag	(14,90 %)	(6,90 %)	(16,64 %)	(16,36 %)	(15,76 %)	(13,43 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,54 %	0,54 %	1,40 %	1,40 %	0,80 %	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,41 %	5,16 %	4,17 %	4,18 %	4,82 %	4,93 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	–	10,00	10,00	10,00	–
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	–	0,00	0,00	0,00	–
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	–	(0,10)	(0,10)	(0,10)	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	–	(0,10)	(0,10)	(0,10)	–
Schlussnettoinventarwert	–	–	9,90	9,90	9,90	–
Gesamtertrag	–	–	(1,00 %)	(1,00 %)	(1,00 %)	–
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	–	1,47 %	1,47 %	0,87 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	–	2,91 %	2,91 %	3,51 %	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,39
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,70)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,31)
Ausschüttungen	(0,27)
Schlussnettoinventarwert	9,42
Gesamtertrag	(2,84 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,54 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Thesaurierende Klasse CHF I4 CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR M €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,78	10,33	11,64	13,27	11,29	11,23
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,47	0,41	0,36	0,49	0,45	0,26
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,29)	(1,85)	(2,06)	(2,34)	(1,99)	(1,98)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,82)	(1,44)	(1,70)	(1,85)	(1,54)	(1,72)
Schlussnettoinventarwert	10,96	8,89	9,94	11,42	9,75	9,51
Gesamtertrag	(14,24 %)	(13,94 %)	(14,60 %)	(13,94 %)	(13,64 %)	(15,32 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,99 %	0,68 %	1,79 %	1,00 %	0,69 %	2,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,05 %	4,35 %	3,18 %	4,14 %	4,44 %	2,56 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	13,02	10,49	11,94	13,49	11,45	11,60
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,47	0,41	0,35	0,51	0,47	0,24
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,71)	(0,57)	(0,65)	(0,73)	(0,63)	(0,61)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,24)	(0,16)	(0,30)	(0,22)	(0,16)	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	12,78	10,33	11,64	13,27	11,29	11,23
Gesamtertrag	(1,84 %)	(1,53 %)	(2,51 %)	(1,63 %)	(1,40 %)	(3,19 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,01 %	0,70 %	1,89 %	1,06 %	0,73 %	2,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,62 %	3,94 %	2,89 %	3,78 %	4,12 %	2,12 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR X €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse SEK A SEK	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,30	11,99	14,13	102,06	8,81	14,03
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,18	0,49	0,57	3,21	0,27	0,43
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,43)	(2,12)	(2,35)	(17,79)	(1,37)	(2,22)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,25)	(1,63)	(1,78)	(14,58)	(1,10)	(1,79)
Ausschüttungen	(0,39)	–	–	–	(0,39)	–
Schlussnettoinventarwert	6,66	10,36	12,35	87,48	7,32	12,24
Gesamtertrag	(15,23 %)	(13,59 %)	(12,60 %)	(14,29 %)	(12,64 %)	(12,76 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,58 %	0,59 %	1,04 %	1,87 %	1,82 %	1,82 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,56 %	4,55 %	4,14 %	3,49 %	3,31 %	3,41 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,99	12,13	14,27	104,21	9,41	14,25
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,18	0,51	0,53	3,12	0,26	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,46)	(0,65)	(0,67)	(5,27)	(0,40)	(0,62)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,28)	(0,14)	(0,14)	(2,15)	(0,14)	(0,22)
Ausschüttungen	(0,41)	–	–	–	(0,46)	–
Schlussnettoinventarwert	8,30	11,99	14,13	102,06	8,81	14,03
Gesamtertrag	(3,20 %)	(1,15 %)	(0,98 %)	(2,06 %)	(1,57 %)	(1,54 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,72 %	0,62 %	1,03 %	1,92 %	1,82 %	1,82 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,12 %	4,22 %	3,70 %	2,99 %	2,84 %	2,84 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD I5 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,80	15,01	10,41	13,54	13,95	10,83
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,23	0,57	0,38	0,53	0,58	0,25
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,71)	(2,38)	(1,63)	(2,14)	(2,21)	(1,70)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,48)	(1,81)	(1,25)	(1,61)	(1,63)	(1,45)
Ausschüttungen	–	–	(0,39)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,32	13,20	8,77	11,93	12,32	9,38
Gesamtertrag	(13,70 %)	(12,06 %)	(12,07 %)	(11,89 %)	(11,68 %)	(13,39 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,82 %	1,02 %	1,02 %	0,86 %	0,62 %	2,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,38 %	4,20 %	4,22 %	4,39 %	4,62 %	2,61 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,08	15,12	10,88	13,63	14,01	11,10
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,20	0,55	0,39	0,52	0,57	0,23
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,48)	(0,66)	(0,47)	(0,61)	(0,63)	(0,50)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,28)	(0,11)	(0,08)	(0,09)	(0,06)	(0,27)
Ausschüttungen	–	–	(0,39)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,80	15,01	10,41	13,54	13,95	10,83
Gesamtertrag	(2,53 %)	(0,73 %)	(0,77 %)	(0,66 %)	(0,43 %)	(2,43 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,82 %	1,02 %	1,02 %	0,86 %	0,62 %	2,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,84 %	3,63 %	3,64 %	3,79 %	4,06 %	2,05 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	8,76
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,20
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,36)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,16)
Ausschüttungen	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	7,19
Gesamtertrag	(13,41 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,60 %
<b>31. Dezember 2021</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	9,40
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,18
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,39)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,21)
Ausschüttungen	(0,43)
Schlussnettoinventarwert	8,76
Gesamtertrag	(2,34 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>	
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,04 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR I3* €	Thesaurierende Klasse EUR I5** €	Thesaurierende Klasse EUR X* €	Thesaurierende Klasse USD I* US\$	Thesaurierende Klasse USD I5* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,12	0,00	0,36	0,34	0,36
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,67	0,01	(2,00)	(1,80)	(1,81)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,79	0,01	(1,64)	(1,46)	(1,45)
Schlussnettoinventarwert	10,79	10,01	8,36	8,54	8,55
Gesamtertrag	7,90 %	0,10 %***	(16,40 %)	(14,60 %)	(14,50 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,61 %	0,15 %	0,45 %	0,89 %	0,53 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,22 %	4,63 %	4,46 %	4,13 %	4,61 %

\*\*Wiederaufnahme der Geschäfte am Dienstag, 27. Dezember 2022.

\*\*\*Die Gesamterträge für den Zeitraum von 8. März 2022 bis 22. November 2022 betrug (9,90) %.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Systematic Global Sustainable Value

	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* £	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I3* US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,86	10,00	18,26	19,19	10,00	20,75
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,08	0,05	0,22	0,35	0,10	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,92)	0,03	(2,65)	(2,83)	(0,63)	(3,02)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,84)	0,08	(2,43)	(2,48)	(0,53)	(2,60)
Schlussnettoinventarwert	14,02	10,08	15,83	16,71	9,47	18,15
Gesamtertrag	(16,84 %)	0,80 %	(13,31 %)	(12,92 %)	(5,30 %)	(12,53 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,98 %	0,53 %	1,22 %	0,76 %	0,64 %	0,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,51 %	1,80 %	1,39 %	2,08 %	1,80 %	2,27 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,38	–	15,29	15,99	–	17,19
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,03)	–	0,17	0,24	–	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	2,51	–	2,80	2,96	–	3,21
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,48	–	2,97	3,20	–	3,56
Schlussnettoinventarwert	16,86	–	18,26	19,19	–	20,75
Gesamtertrag	17,25 %	–	19,42 %	20,01 %	–	20,71 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	2,53 %	–	1,35 %	0,99 %	–	0,53 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,16 %)	–	0,96 %	1,34 %	–	1,79 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Ultra Short Term Euro Bond

	Thesaurierende Klasse CHF P* CHF	Thesaurierende Klasse CHF U CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	100,00	102,92	99,83	105,08	102,73	103,78
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	1,20	1,71	1,46	1,80	1,82	1,80
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,72)	(7,72)	(7,20)	(7,67)	(7,54)	(7,56)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,52)	(6,01)	(5,74)	(5,87)	(5,72)	(5,76)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(1,57)	–
Schlussnettoinventarwert	97,48	96,91	94,09	99,21	95,44	98,02
Gesamtertrag	(2,52 %)	(5,84 %)	(5,75 %)	(5,59 %)	(5,58 %)	(5,55 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,28 %	0,37 %	0,47 %	0,28 %	0,28 %	0,24 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,09 %	1,73 %	1,51 %	1,78 %	1,87 %	1,80 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	102,25	100,00	104,00	102,78	102,68
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	0,83	0,44	0,99	0,97	1,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	(0,16)	(0,61)	0,09	0,08	0,08
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	0,67	(0,17)	1,08	1,05	1,10
Ausschüttungen	–	–	–	–	(1,10)	–
Schlussnettoinventarwert	–	102,92	99,83	105,08	102,73	103,78
Gesamtertrag	–	0,66 %	(0,17 %)	1,04 %	1,03 %	1,07 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	0,41 %	0,56 %	0,33 %	0,32 %	0,28 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	0,81 %	0,79 %	0,94 %	0,94 %	0,98 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR 15 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR U €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	105,34	99,50	103,38	105,86	99,95	111,22
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	1,90	1,16	1,61	1,79	1,71	2,22
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(7,68)	(7,44)	(7,48)	(7,48)	(5,33)	(6,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,78)	(6,28)	(5,87)	(5,69)	(3,62)	(3,82)
Schlussnettoinventarwert	99,56	93,22	97,51	100,17	96,33	107,40
Gesamtertrag	(5,49 %)	(6,31 %)	(5,68 %)	(5,38 %)	(3,62 %)	(3,43 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,18 %	1,07 %	0,37 %	0,08 %	0,28 %	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,88 %	1,23 %	1,60 %	1,74 %	1,78 %	2,06 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	104,17	100,00	102,42	104,59	100,00	109,03
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	1,09	0,08	0,87	1,20	0,28	1,21
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,08	(0,58)	0,09	0,07	(0,33)	0,98
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,17	(0,50)	0,96	1,27	(0,05)	2,19
Schlussnettoinventarwert	105,34	99,50	103,38	105,86	99,95	111,22
Gesamtertrag	1,12 %	(0,50 %)	0,94 %	1,21 %	(0,05 %)	2,01 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,22 %	1,11 %	0,42 %	0,16 %	0,31 %	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,04 %	0,18 %	0,85 %	1,14 %	0,95 %	1,10 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies

	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Thesaurierende Klasse CHF I5 CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,72	10,05	9,52	9,86	10,16	10,29
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,40)	(0,23)	(0,45)	(0,43)	(0,38)	(0,35)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,02	0,92	1,00	1,08	1,07	1,07
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,62	0,69	0,55	0,65	0,69	0,72
Schlussnettoinventarwert	10,34	10,74	10,07	10,51	10,85	11,01
Gesamtertrag	6,38 %	6,87 %	5,78 %	6,59 %	6,79 %	7,00 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	4,09 %	2,60 %	4,66 %	4,22 %	4,81 %	3,48 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(3,87 %)	(2,14 %)	(4,47 %)	(4,08 %)	(3,56 %)	(3,22 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,88	10,19	9,73	10,01	10,30	10,41
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,28)	(0,24)	(0,35)	(0,29)	(0,28)	(0,25)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,12	0,10	0,14	0,14	0,14	0,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,16)	(0,14)	(0,21)	(0,15)	(0,14)	(0,12)
Schlussnettoinventarwert	9,72	10,05	9,52	9,86	10,16	10,29
Gesamtertrag	(1,62 %)	(1,37 %)	(2,16 %)	(1,50 %)	(1,36 %)	(1,15 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,83 %	2,31 %	3,69 %	2,87 %	2,65 %	2,36 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,90 %)	(2,43 %)	(3,71 %)	(2,93 %)	(2,76 %)	(2,47 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR P* €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2* £	Thesaurierende Klasse GBP I5 £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,37	10,00	10,61	10,63	10,00	10,77
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,41)	(0,07)	(0,40)	(0,41)	0,03	(0,35)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,87	(0,08)	1,31	1,34	(0,07)	1,32
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,46	(0,15)	0,91	0,93	(0,04)	0,97
Schlussnettoinventarwert	9,83	9,85	11,52	11,56	9,96	11,74
Gesamtertrag	4,91 %	(1,50 %)	8,58 %	8,75 %	(0,40 %)	9,01 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	4,67 %	2,02 %	3,89 %	3,89 %	0,19 %	3,39 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(4,23 %)	(1,39 %)	(3,58 %)	(3,62 %)	0,76 %	(3,05 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,66	–	10,70	10,71	–	10,83
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,43)	–	(0,31)	(0,28)	–	(0,26)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,14	–	0,22	0,20	–	0,20
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,29)	–	(0,09)	(0,08)	–	(0,06)
Schlussnettoinventarwert	9,37	–	10,61	10,63	–	10,77
Gesamtertrag	(3,00 %)	–	(0,84 %)	(0,75 %)	–	(0,55 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	4,33 %	–	2,76 %	2,60 %	–	2,34 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(4,54 %)	–	(2,90 %)	(2,65 %)	–	(2,45 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse JPY I* ¥	Thesaurierende Klasse SGD A* SGD	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,27	10,98	1.000,00	20,00	10,26	9,92
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,41)	(0,36)	(11,88)	0,00	(0,39)	(0,58)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,30	1,40	41,77	0,11	1,16	1,23
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,89	1,04	29,89	0,11	0,77	0,65
Schlussnettoinventarwert	11,16	12,02	1.029,89	20,11	11,03	10,57
Gesamtertrag	8,67 %	9,47 %	2,99 %	0,55 %	7,50 %	6,55 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	4,02 %	3,32 %	2,08 %	2,22 %	4,02 %	5,76 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(3,71 %)	(3,06 %)	(1,53 %)	(0,57 %)	(3,62 %)	(5,52 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,36	11,00	–	–	10,41	10,17
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,28)	(0,21)	–	–	(0,36)	(0,45)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,19	0,19	–	–	0,21	0,20
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,09)	(0,02)	–	–	(0,15)	(0,25)
Schlussnettoinventarwert	10,27	10,98	–	–	10,26	9,92
Gesamtertrag	(0,87 %)	(0,18 %)	–	–	(1,44 %)	(2,46 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,69 %	1,86 %	–	–	3,41 %	4,37 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,75 %)	(1,95 %)	–	–	(3,56 %)	(4,55 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD I5 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD P US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,05	11,07	11,24	10,21	10,76	11,28
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,40)	(0,44)	(0,36)	(0,52)	(0,29)	(0,25)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,32	1,38	1,34	1,20	1,19	1,29
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,92	0,94	0,98	0,68	0,90	1,04
Schlussnettoinventarwert	11,97	12,01	12,22	10,89	11,66	12,32
Gesamtertrag	8,33 %	8,49 %	8,72 %	6,66 %	8,36 %	9,22 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,69 %	3,97 %	3,28 %	5,14 %	3,03 %	2,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(3,36 %)	(3,73 %)	(2,97 %)	(4,80 %)	(2,53 %)	(2,04 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,13	11,14	11,28	10,44	10,83	11,28
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,31)	(0,29)	(0,27)	(0,45)	(0,29)	(0,01)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,23	0,22	0,23	0,22	0,22	0,01
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,08)	(0,07)	(0,04)	(0,23)	(0,07)	0,00
Schlussnettoinventarwert	11,05	11,07	11,24	10,21	10,76	11,28
Gesamtertrag	(0,72 %)	(0,63 %)	(0,35 %)	(2,20 %)	(0,65 %)	0,00 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,73 %	2,54 %	2,32 %	4,21 %	2,37 %	0,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,82 %)	(2,63 %)	(2,43 %)	(4,37 %)	(2,70 %)	(0,12 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

XXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR X* €	Thesaurierende Klasse USD X* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,04)	(0,04)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,13)	0,04
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,17)	0,00
Schlussnettoinventarwert	9,83	10,00
Gesamtertrag	(1,70 %)	0,00 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>		
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,28 %	1,30 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,81 %)	(0,83 %)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity

	Thesaurierende Klasse JPY I3* ¥	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD M* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	1.000,00	18,74	27,49	27,28	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	1,47	(0,12)	(0,02)	(0,02)	(0,12)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(185,43)	(4,86)	(7,13)	(7,08)	(2,14)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(183,96)	(4,98)	(7,15)	(7,10)	(2,26)
Schlussnettoinventarwert	816,04	13,76	20,34	20,18	7,74
Gesamtertrag	(18,40 %)	(26,57 %)	(26,01 %)	(26,03 %)	(22,60 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,73 %	1,72 %	0,97 %	0,97 %	2,52 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,21 %	(0,81 %)	(0,08 %)	(0,10 %)	(1,58 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	–	15,53	22,61	22,44	–
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	(0,19)	(0,08)	(0,08)	–
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	3,40	4,96	4,92	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	3,21	4,88	4,84	–
Schlussnettoinventarwert	–	18,74	27,49	27,28	–
Gesamtertrag	–	20,67 %	21,58 %	21,57 %	–

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	–	1,74 %	0,99 %	0,99 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	(1,09 %)	(0,32 %)	(0,32 %)	–

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Equity Index PutWrite

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I4 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse GBP I3 £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,45	10,38	13,37	12,56	13,50	11,49
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,00	0,02	0,03	(0,16)	0,00	0,02
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,76)	(1,35)	(1,75)	(1,64)	0,08	0,07
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,76)	(1,33)	(1,72)	(1,80)	0,08	0,09
Ausschüttungen	–	(0,22)	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,69	8,83	11,65	10,76	13,58	11,58
Gesamtertrag	(13,09 %)	(12,93 %)	(12,86 %)	(14,33 %)	0,59 %	0,78 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,70 %	0,52 %	0,46 %	2,08 %	0,73 %	0,54 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,00	0,17 %	0,24 %	(1,38 %)	0,00	0,19 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,47	10,00	11,37	10,85	11,30	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,11	0,00	0,14	(0,07)	0,09	0,05
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,87	0,38	1,86	1,78	2,11	1,44
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,98	0,38	2,00	1,71	2,20	1,49
Schlussnettoinventarwert	13,45	10,38	13,37	12,56	13,50	11,49
Gesamtertrag	17,26 %	3,80 %	17,59 %	15,76 %	19,47 %	14,90 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,81 %	0,69 %	0,56 %	2,27 %	0,75 %	0,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,88 %	0,17 %	1,14 %	(0,58 %)	0,74 %	0,70 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I3 £	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) £	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) £	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,90	13,93	10,40	22,21	14,70	12,29
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,02	0,03	0,00	(0,12)	(0,08)	0,00
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,29)	0,09	0,07	(2,44)	(1,56)	(1,30)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,27)	0,12	0,07	(2,56)	(1,64)	(1,30)
Ausschüttungen	(0,23)	–	(0,41)	(0,80)	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	9,40	14,05	10,06	18,85	13,06	10,55
Gesamtertrag	(11,73 %)	0,86 %	0,64 %	(11,67 %)	(11,16 %)	(10,66 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,54 %	0,48 %	0,70 %	1,27 %	1,31 %	0,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,17 %	0,24 %	0,03 %	(0,59 %)	(0,60 %)	0,00
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,51	11,63	10,00	19,67	12,51	10,81
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,00	0,14	0,01	0,05	0,05	0,08
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,39	2,16	0,49	3,33	2,14	1,86
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,39	2,30	0,50	3,38	2,19	1,94
Ausschüttungen	–	–	(0,10)	(0,84)	–	(0,46)
Schlussnettoinventarwert	10,90	13,93	10,40	22,21	14,70	12,29
Gesamtertrag	3,71 %	19,78 %	5,06 %	17,51 %	17,51 %	18,32 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,67 %	0,54 %	0,81 %	1,36 %	1,39 %	0,79 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,17 %	1,07 %	0,24 %	0,24 %	0,36 %	0,65 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I3 US\$	Thesaurierende Klasse USD I4 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	15,34	10,39	14,84	13,98	15,43
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,00	0,02	0,03	(0,18)	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,63)	(1,10)	(1,58)	(1,48)	(1,64)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,63)	(1,08)	(1,55)	(1,66)	(1,56)
Ausschüttungen	–	(0,22)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	13,71	9,09	13,29	12,32	13,87
Gesamtertrag	(10,63 %)	(10,45 %)	(10,44 %)	(11,87 %)	(10,11 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,71 %	0,53 %	0,47 %	2,11 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,00	0,17 %	0,25 %	(1,40 %)	0,59 %
<b>31. Dezember 2021</b>					
Eröffnungsnettoinventarwert	12,96	10,00	12,51	11,97	12,95
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>					
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,11	0,00	0,15	(0,08)	0,20
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	2,27	0,39	2,18	2,09	2,28
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,38	0,39	2,33	2,01	2,48
Schlussnettoinventarwert	15,34	10,39	14,84	13,98	15,43
Gesamtertrag	18,36 %	3,90 %	18,63 %	16,79 %	19,15 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>					
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,77 %	0,67 %	0,54 %	2,18 %	0,17 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,78 %	0,15 %	1,11 %	(0,60 %)	1,38 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup>

	Thesaurierende Klasse EUR A* €	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* €	Thesaurierende Klasse EUR I* €	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* €	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* €	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,01	0,02	0,08	0,07	0,10	0,14
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,86	0,66	(0,88)	(0,65)	(0,19)	0,28
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,87	0,68	(0,80)	(0,58)	(0,09)	0,42
Schlussnettoinventarwert	10,87	10,68	9,20	9,42	9,91	10,42
Gesamtertrag	8,70 %	6,80 %	(8,00 %)	(5,80 %)	(0,90 %)	4,20 %

**Verhältnis zum  
durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,62 %	1,57 %	0,76 %	0,75 %	0,48 %	0,43 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,38 %	0,33 %	1,19 %	1,12 %	1,33 %	1,44 %

	Thesaurierende Klasse GBP I* £	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* £	Ausschüttende Klasse GBP I* £	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* £	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)* £	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* £
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,01	0,01	0,01	0,01	0,12	0,07
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,25)	(0,35)	(0,25)	(0,35)	0,80	0,21
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,24)	(0,34)	(0,24)	(0,34)	0,92	0,28
Schlussnettoinventarwert	9,76	9,66	9,76	9,66	10,92	10,28
Gesamtertrag	(2,40 %)	(3,40 %)	(2,40 %)	(3,40 %)	9,20 %	2,80 %

**Verhältnis zum  
durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	0,86 %	0,87 %	0,86 %	0,87 %	0,50 %	0,77 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,94 %	0,94 %	0,94 %	0,94 %	1,39 %	1,22 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP P* £	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* £	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* £	Thesaurierende Klasse USD A* US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I4* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,39	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,02	0,08	0,04	0,03	0,11	0,10
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,61	0,40	0,25	(0,53)	(0,22)	(0,47)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,63	0,48	0,29	(0,50)	(0,11)	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	10,63	10,48	10,29	9,50	10,28	9,63
Gesamtertrag	6,30 %	4,80 %	2,90 %	(5,00 %)	(1,06 %)	(3,70 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,78 %	0,71 %	0,72 %	1,59 %	0,80 %	0,50 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,16 %	1,37 %	1,18 %	0,39 %	1,16 %	1,40 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	–	–	–	10,00	–
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	–	–	–	–	(0,16)	–
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	–	–	–	–	0,55	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	–	–	–	0,39	–
Schlussnettoinventarwert	–	–	–	–	10,39	–
Gesamtertrag	–	–	–	–	3,90 %	–
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	–	–	–	–	1,95 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	–	–	–	(0,36 %)	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup> (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5* US\$	Thesaurierende Klasse USD M* US\$	Thesaurierende Klasse USD Z* US\$
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,13	(0,03)	0,11
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,48)	(0,62)	(0,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,35)	(0,65)	0,10
Schlussnettoinventarwert	9,65	9,35	10,10
Gesamtertrag	(3,50 %)	(6,50 %)	1,00 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>			
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,44 %	2,40 %	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,56 %	(0,42 %)	1,85 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Ausschüttende Klasse GBP I3 £	Thesaurierende Klasse SGD A1 SGD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,66	12,47	11,67	11,53	10,98	26,43
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,12)	(0,03)	0,01	(0,20)	0,01	(0,22)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,14)	(1,22)	(1,14)	(1,12)	(0,91)	(2,08)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,26)	(1,25)	(1,13)	(1,32)	(0,90)	(2,30)
Schlussnettoinventarwert	10,40	11,22	10,54	10,21	10,08	24,13
Gesamtertrag	(10,81 %)	(10,02 %)	(9,68 %)	(11,45 %)	(8,20 %)	(8,70 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,41 %	1,51 %	1,11 %	3,19 %	1,17 %	2,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,13 %)	(0,24 %)	0,11 %	(1,90 %)	0,05 %	(0,88 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,35	12,02	11,20	11,31	10,48	25,44
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,18)	(0,08)	(0,02)	(0,27)	(0,02)	(0,33)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,49	0,53	0,49	0,49	0,52	1,32
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,31	0,45	0,47	0,22	0,50	0,99
Schlussnettoinventarwert	11,66	12,47	11,67	11,53	10,98	26,43
Gesamtertrag	2,73 %	3,74 %	4,20 %	1,95 %	4,77 %	3,89 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,55 %	1,61 %	1,19 %	3,39 %	1,16 %	2,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,56 %)	(0,62 %)	(0,20 %)	(2,39 %)	(0,16 %)	(1,26 %)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A (PF) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD A1 US\$	Ausschüttende Klasse USD I (PF) US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I3 US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,74	12,97	13,77	13,31	14,61	11,85
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,06)	(0,14)	(0,11)	0,02	(0,02)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,96)	(0,97)	(1,03)	(1,00)	(1,10)	(0,87)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,02)	(1,11)	(1,14)	(0,98)	(1,12)	(0,86)
Schlussnettoinventarwert	11,72	11,86	12,63	12,33	13,49	10,99
Gesamtertrag	(8,01 %)	(8,56 %)	(8,28 %)	(7,36 %)	(7,67 %)	(7,26 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,89 %	2,44 %	2,19 %	1,18 %	1,53 %	1,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,54 %)	(1,11 %)	(0,86 %)	0,16 %	(0,14 %)	0,11 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	12,34	12,51	13,25	12,79	13,96	11,28
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,23)	(0,19)	(0,17)	(0,15)	(0,09)	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,63	0,65	0,69	0,67	0,74	0,59
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,40	0,46	0,52	0,52	0,65	0,57
Schlussnettoinventarwert	12,74	12,97	13,77	13,31	14,61	11,85
Gesamtertrag	3,24 %	3,68 %	3,92 %	4,07 %	4,66 %	5,05 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,78 %	2,44 %	2,20 %	2,10 %	1,55 %	1,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,83 %)	(1,50 %)	(1,25 %)	(1,14 %)	(0,60 %)	(0,20 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD U US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>			
Eröffnungsnettoinventarwert	12,11	13,49	15,93
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,21)	(0,08)	0,17
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,92)	(1,02)	(1,20)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,13)	(1,10)	(1,03)
Schlussnettoinventarwert	10,98	12,39	14,90
Gesamtertrag	(9,33 %)	(8,15 %)	(6,47 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,23 %	1,98 %	0,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,89 %)	(0,65 %)	1,10 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	11,77	12,95	15,02
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>			
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,28)	(0,14)	0,12
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	0,62	0,68	0,79
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,34	0,54	0,91
Schlussnettoinventarwert	12,11	13,49	15,93
Gesamtertrag	2,89 %	4,17 %	6,06 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,26 %	2,00 %	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,31 %)	(1,05 %)	0,75 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

	Thesaurierende Klasse AUD E AUD	Thesaurierende Klasse AUD T AUD	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR1 A €	Thesaurierende Klasse EUR1 I €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	20,43	18,99	28,01	20,22	31,56	34,13
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,36)	(0,17)	0,06	(0,33)	(0,25)	(0,03)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,89)	(3,63)	(5,54)	(3,98)	(6,23)	(6,74)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,25)	(3,80)	(5,48)	(4,31)	(6,48)	(6,77)
Schlussnettoinventarwert	16,18	15,19	22,53	15,91	25,08	27,36
Gesamtertrag	(20,80 %)	(20,01 %)	(19,56 %)	(21,32 %)	(20,53 %)	(19,84 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,01 %	1,99 %	0,64 %	2,81 %	1,82 %	0,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,09 %)	(1,07 %)	0,24 %	(1,93 %)	(0,94 %)	(0,11 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	16,78	15,44	22,52	16,62	25,68	27,54
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,42)	(0,21)	0,04	(0,40)	(0,32)	(0,05)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	4,07	3,76	5,45	4,00	6,20	6,64
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,65	3,55	5,49	3,60	5,88	6,59
Schlussnettoinventarwert	20,43	18,99	28,01	20,22	31,56	34,13
Gesamtertrag	21,75 %	22,99 %	24,38 %	21,66 %	22,90 %	23,93 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,08 %	2,04 %	0,71 %	3,00 %	1,95 %	1,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,25 %)	(1,22 %)	0,16 %	(2,14 %)	(1,10 %)	(0,17 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse SGD A SGD	Thesaurierende Klasse USD B US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Thesaurierende Klasse USD C2 US\$	Thesaurierende Klasse USD E US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	17,50	51,87	21,90	16,74	21,89	20,60
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,04	(0,41)	(0,38)	(0,28)	(0,38)	(0,36)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,14)	(9,20)	(3,72)	(2,84)	(3,71)	(3,49)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,10)	(9,61)	(4,10)	(3,12)	(4,09)	(3,85)
Ausschüttungen	(0,02)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	16,38	42,26	17,80	13,62	17,80	16,75
Gesamtertrag	(6,27 %)	(18,53 %)	(18,72 %)	(18,64 %)	(18,68 %)	(18,69 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,66 %	1,80 %	2,95 %	2,85 %	2,95 %	2,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,22 %	(0,93 %)	(2,06 %)	(1,96 %)	(2,06 %)	(2,05 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,83	41,85	17,83	13,62	17,83	16,78
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,02	(0,50)	(0,45)	(0,32)	(0,43)	(0,42)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,67	10,52	4,52	3,44	4,49	4,24
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,69	10,02	4,07	3,12	4,06	3,82
Ausschüttungen	(0,02)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	17,50	51,87	21,90	16,74	21,89	20,60
Gesamtertrag	26,72 %	23,94 %	22,83 %	22,91 %	22,77 %	22,77 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	1,88 %	2,97 %	2,89 %	2,99 %	2,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,10 %	(1,07 %)	(2,18 %)	(2,06 %)	(2,17 %)	(2,19 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I3 US\$	Ausschüttende Klasse USD I3 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD T US\$	Thesaurierende Klasse USD U US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	31,41	28,22	23,28	23,75	32,48	26,38
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,06	0,06	(0,40)	(0,21)	(0,14)	0,17
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(5,33)	(4,80)	(3,93)	(4,03)	(5,52)	(4,49)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,27)	(4,74)	(4,33)	(4,24)	(5,66)	(4,32)
Ausschüttungen	–	(0,04)	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	26,14	23,44	18,95	19,51	26,82	22,06
Gesamtertrag	(16,78 %)	(16,82 %)	(18,60 %)	(17,85 %)	(17,43 %)	(16,38 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,65 %	0,65 %	2,85 %	1,95 %	1,40 %	0,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,23 %	0,24 %	(2,00 %)	(1,05 %)	(0,51 %)	0,75 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	25,00	22,49	18,94	19,15	26,05	20,89
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,04	0,04	(0,44)	(0,26)	(0,18)	0,15
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	6,37	5,72	4,78	4,86	6,61	5,34
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	6,41	5,76	4,34	4,60	6,43	5,49
Ausschüttungen	–	(0,03)	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	31,41	28,22	23,28	23,75	32,48	26,38
Gesamtertrag	25,64 %	25,64 %	22,91 %	24,02 %	24,68 %	26,28 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,68 %	0,68 %	2,89 %	1,97 %	1,43 %	0,17 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,14 %	0,14 %	(2,07 %)	(1,18 %)	(0,61 %)	0,62 %

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD1 A US\$	Thesaurierende Klasse USD1 I US\$	Ausschüttende Klasse USD1 I US\$	Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	35,57	39,46	38,08	310,31	308,51	285,76
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,29)	(0,04)	(0,04)	(5,76)	(5,81)	(5,27)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(6,04)	(6,71)	(6,47)	(45,87)	(45,51)	(42,27)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(6,33)	(6,75)	(6,51)	(51,63)	(51,32)	(47,54)
Schlussnettoinventarwert	29,24	32,71	31,57	258,68	257,19	238,22
Gesamtertrag	(17,80 %)	(17,11 %)	(17,10 %)	(16,64 %)	(16,63 %)	(16,64 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,85 %	1,00 %	1,00 %	3,06 %	3,06 %	3,06 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,96 %)	(0,12 %)	(0,12 %)	(2,14 %)	(2,13 %)	(2,13 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	28,65	31,52	30,41	242,23	240,82	223,06
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,34)	(0,08)	(0,07)	(6,48)	(6,42)	(6,09)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	7,26	8,02	7,74	74,56	74,11	68,79
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	6,92	7,94	7,67	68,08	67,69	62,70
Schlussnettoinventarwert	35,57	39,46	38,08	310,31	308,51	285,76
Gesamtertrag	24,15 %	25,19 %	25,22 %	28,11 %	28,11 %	28,11 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,88 %	1,03 %	1,02 %	3,22 %	3,22 %	3,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,05 %)	(0,21 %)	(0,21 %)	(2,34 %)	(2,35 %)	(2,36 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>	
Eröffnungsnettoinventarwert	336,29
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(3,19)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(49,93)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(53,12)
Schlussnettoinventarwert	283,17
Gesamtertrag	(15,80 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,09 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	259,90
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>	
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(3,83)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	80,22
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	76,39
Schlussnettoinventarwert	336,29
Gesamtertrag	29,39 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,27 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD E AUD
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,16	11,41	16,33	11,42	11,40	17,67
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,07	(0,06)	(0,08)	(0,09)	(0,05)	(0,09)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,70)	(3,45)	(5,03)	(3,42)	(3,46)	(5,44)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,63)	(3,51)	(5,11)	(3,51)	(3,51)	(5,53)
Ausschüttungen	(0,40)	(0,37)	–	(0,37)	(0,37)	–
Schlussnettoinventarwert	8,13	7,53	11,22	7,54	7,52	12,14
Gesamtertrag	(30,39 %)	(31,29 %)	(31,29 %)	(31,26 %)	(31,32 %)	(31,30 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,78 %	3,11 %	3,11 %	3,09 %	3,11 %	3,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,73 %	(0,60 %)	(0,63 %)	(0,86 %)	(0,55 %)	(0,60 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,08	8,63	11,87	8,65	8,62	12,85
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,04	(0,09)	(0,13)	(0,09)	(0,09)	(0,15)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,45	3,26	4,59	3,25	3,26	4,97
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,49	3,17	4,46	3,16	3,17	4,82
Ausschüttungen	(0,41)	(0,39)	–	(0,39)	(0,39)	–
Schlussnettoinventarwert	12,16	11,41	16,33	11,42	11,40	17,67
Gesamtertrag	39,36 %	37,59 %	37,57 %	37,39 %	37,62 %	37,51 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,83 %	3,20 %	3,21 %	3,21 %	3,22 %	3,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,34 %	(0,94 %)	(0,93 %)	(0,92 %)	(0,88 %)	(0,99 %)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD T AUD	Thesaurierende Klasse CHF A CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR M €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,11	20,70	19,35	11,56	25,33	15,75
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,04	0,08	0,11	0,02	0,22	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,98)	(6,41)	(6,14)	(3,60)	(7,92)	(4,95)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,94)	(6,33)	(6,03)	(3,58)	(7,70)	(4,97)
Ausschüttungen	(0,43)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,74	14,37	13,32	7,98	17,63	10,78
Gesamtertrag	(30,59 %)	(30,58 %)	(31,16 %)	(30,97 %)	(30,40 %)	(31,56 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,09 %	2,09 %	1,69 %	1,71 %	0,97 %	2,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,41 %	0,47 %	0,69 %	0,20 %	1,00 %	(0,15 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,82	14,90	13,97	8,31	18,10	11,46
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,01	0,00	0,07	0,00	0,25	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,73	5,80	5,31	3,25	6,98	4,39
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,74	5,80	5,38	3,25	7,23	4,29
Ausschüttungen	(0,45)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	13,11	20,70	19,35	11,56	25,33	15,75
Gesamtertrag	38,93 %	38,93 %	38,51 %	39,11 %	39,94 %	37,43 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,18 %	2,15 %	1,80 %	1,84 %	1,08 %	2,89 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,11 %	0,02 %	0,39 %	0,04 %	1,16 %	(0,71 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) HKD	Thesaurierende Klasse SGD A SGD	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,92	39,53	14,78	30,68	22,25	12,47
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,07	0,20	0,08	0,18	0,13	(0,06)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,74)	(11,74)	(4,22)	(8,94)	(6,47)	(3,55)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,67)	(11,54)	(4,14)	(8,76)	(6,34)	(3,61)
Ausschüttungen	(0,43)	–	(0,49)	–	(0,10)	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	8,82	27,99	10,15	21,92	15,81	8,45
Gesamtertrag	(28,92 %)	(29,19 %)	(28,50 %)	(28,55 %)	(28,53 %)	(29,45 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,74 %	1,70 %	1,75 %	1,75 %	1,75 %	3,05 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,71 %	0,61 %	0,69 %	0,72 %	0,71 %	(0,57 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,60	28,23	10,97	21,88	16,21	9,38
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,04	0,11	0,05	0,11	0,05	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,72	11,19	4,26	8,69	6,33	3,62
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,76	11,30	4,31	8,80	6,38	3,52
Ausschüttungen	(0,44)	–	(0,50)	–	(0,34)	(0,43)
Schlussnettoinventarwert	12,92	39,53	14,78	30,68	22,25	12,47
Gesamtertrag	40,05 %	40,03 %	40,21 %	40,22 %	40,18 %	38,34 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,78 %	1,79 %	1,78 %	1,79 %	1,77 %	3,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,39 %	0,31 %	0,41 %	0,40 %	0,27 %	(0,88 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD B US\$	Thesaurierende Klasse USD C1 US\$	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD C2 US\$	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD E US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	19,11	15,90	12,63	19,10	12,47	18,13
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,09)	(0,05)	(0,08)	(0,10)	(0,06)	(0,09)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(5,54)	(4,60)	(3,57)	(5,53)	(3,55)	(5,25)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,63)	(4,65)	(3,65)	(5,63)	(3,61)	(5,34)
Ausschüttungen	–	–	(0,42)	–	(0,41)	–
Schlussnettoinventarwert	13,48	11,25	8,56	13,47	8,45	12,79
Gesamtertrag	(29,46 %)	(29,25 %)	(29,43 %)	(29,48 %)	(29,45 %)	(29,45 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,05 %	2,74 %	3,04 %	3,05 %	3,05 %	3,04 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,58 %)	(0,34 %)	(0,76 %)	(0,64 %)	(0,61 %)	(0,62 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	13,81	11,45	9,49	13,80	9,38	13,10
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,16)	(0,08)	(0,12)	(0,17)	(0,10)	(0,14)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	5,46	4,53	3,69	5,47	3,62	5,17
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	5,30	4,45	3,57	5,30	3,52	5,03
Ausschüttungen	–	–	(0,43)	–	(0,43)	–
Schlussnettoinventarwert	19,11	15,90	12,63	19,10	12,47	18,13
Gesamtertrag	38,38 %	38,86 %	38,50 %	38,41 %	38,34 %	38,40 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,08 %	2,81 %	3,11 %	3,09 %	3,11 %	3,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,94 %)	(0,62 %)	(1,14 %)	(1,02 %)	(0,93 %)	(0,91 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,56	34,38	20,43	25,22	18,55	14,20
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,15	0,42	0,25	0,38	(0,05)	0,05
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(3,60)	(10,05)	(5,94)	(7,41)	(5,38)	(4,06)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,45)	(9,63)	(5,69)	(7,03)	(5,43)	(4,01)
Ausschüttungen	(0,42)	–	(0,23)	–	–	(0,47)
Schlussnettoinventarwert	8,69	24,75	14,51	18,19	13,12	9,72
Gesamtertrag	(27,96 %)	(28,01 %)	(28,01 %)	(27,87 %)	(29,27 %)	(28,73 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,00 %	1,00 %	1,00 %	0,81 %	2,75 %	2,05 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,44 %	1,46 %	1,50 %	1,90 %	(0,30 %)	0,44 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	9,25	24,33	14,88	17,82	13,36	10,57
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,13	0,34	0,20	0,30	(0,10)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,61	9,71	5,78	7,10	5,29	4,10
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,74	10,05	5,98	7,40	5,19	4,11
Ausschüttungen	(0,43)	–	(0,43)	–	–	(0,48)
Schlussnettoinventarwert	12,56	34,38	20,43	25,22	18,55	14,20
Gesamtertrag	41,30 %	41,31 %	41,27 %	41,53 %	38,85 %	39,80 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,01 %	1,05 %	1,03 %	0,85 %	2,80 %	2,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,14 %	1,16 %	1,13 %	1,40 %	(0,59 %)	0,07 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD T US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	20,76	19,79	117,12	224,68	115,79	221,86
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,07	0,35	(0,55)	(1,15)	(0,71)	(1,13)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(6,04)	(5,78)	(30,67)	(61,02)	(30,15)	(60,26)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,97)	(5,43)	(31,22)	(62,17)	(30,86)	(61,39)
Ausschüttungen	–	–	(7,79)	–	(7,70)	–
Schlussnettoinventarwert	14,79	14,36	78,11	162,51	77,23	160,47
Gesamtertrag	(28,76 %)	(27,44 %)	(27,64 %)	(27,67 %)	(27,63 %)	(27,67 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,05 %	0,24 %	3,16 %	3,16 %	3,16 %	3,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,42 %	2,09 %	(0,58 %)	(0,60 %)	(0,73 %)	(0,60 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	14,85	13,91	88,45	155,84	87,45	153,87
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	0,00	0,32	(0,94)	(1,97)	(0,95)	(2,11)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	5,91	5,56	38,13	70,81	37,72	70,10
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	5,91	5,88	37,19	68,84	36,77	67,99
Ausschüttungen	–	–	(8,52)	–	(8,43)	–
Schlussnettoinventarwert	20,76	19,79	117,12	224,68	115,79	221,86
Gesamtertrag	39,80 %	42,27 %	44,13 %	44,17 %	44,12 %	44,19 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	2,08 %	0,30 %	3,35 %	3,35 %	3,36 %	3,31 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,02 %	1,90 %	(0,91 %)	(1,05 %)	(0,94 %)	(1,12 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	117,13	251,37	178,43	305,79
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,53)	(1,16)	0,61	1,28
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(30,69)	(68,40)	(46,92)	(83,67)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(31,22)	(69,56)	(46,31)	(82,39)
Ausschüttungen	(7,79)	–	(11,92)	–
Schlussnettoinventarwert	78,12	181,81	120,20	223,40
Gesamtertrag	(27,63 %)	(27,67 %)	(26,91 %)	(26,94 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,16 %	3,16 %	2,12 %	2,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,56 %)	(0,55 %)	0,42 %	0,50 %
<b>31. Dezember 2021</b>				
Eröffnungsnettoinventarwert	88,45	174,35	133,39	209,98
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>				
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(1,03)	(2,35)	(0,09)	0,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	38,23	79,37	58,05	95,79
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	37,20	77,02	57,96	95,81
Ausschüttungen	(8,52)	–	(12,92)	–
Schlussnettoinventarwert	117,13	251,37	178,43	305,79
Gesamtertrag	44,14 %	44,18 %	45,60 %	45,63 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>				
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,33 %	3,34 %	2,25 %	2,26 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,99 %)	(1,10 %)	(0,06 %)	0,01 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Thesaurierende Klasse AUD C2 AUD	Thesaurierende Klasse AUD E AUD	Thesaurierende Klasse AUD T AUD	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,09	13,74	19,71	18,03	19,76	14,80
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,27)	(0,26)	(0,38)	(0,19)	(0,19)	(0,14)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(2,96)	(2,89)	(4,13)	(3,80)	(4,28)	(2,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,23)	(3,15)	(4,51)	(3,99)	(4,47)	(2,17)
Schlussnettoinventarwert	10,86	10,59	15,20	14,04	15,29	12,63
Gesamtertrag	(22,92 %)	(22,93 %)	(22,88 %)	(22,13 %)	(22,62 %)	(14,66 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,01 %	2,98 %	3,01 %	1,99 %	1,82 %	1,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,33 %)	(2,27 %)	(2,33 %)	(1,29 %)	(1,15 %)	(1,09 %)
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,31	12,01	17,23	15,61	17,11	11,78
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,33)	(0,33)	(0,46)	(0,24)	(0,25)	(0,18)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	2,11	2,06	2,94	2,66	2,90	3,20
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,78	1,73	2,48	2,42	2,65	3,02
Schlussnettoinventarwert	14,09	13,74	19,71	18,03	19,76	14,80
Gesamtertrag	14,46 %	14,40 %	14,39 %	15,50 %	15,49 %	25,64 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	3,06 %	3,06 %	3,06 %	2,03 %	1,93 %	1,93 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,43 %)	(2,51 %)	(2,46 %)	(1,40 %)	(1,35 %)	(1,33 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) €	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR Z €
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	23,17	19,01	17,70	10,00	20,22	21,73
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,08)	(0,05)	(0,02)	0,01	(0,35)	0,10
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(5,01)	(2,60)	(2,42)	(0,15)	(4,38)	(4,73)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,09)	(2,65)	(2,44)	(0,14)	(4,73)	(4,63)
Schlussnettoinventarwert	18,08	16,36	15,26	9,86	15,49	17,10
Gesamtertrag	(21,97 %)	(13,94 %)	(13,79 %)	(1,40 %)	(23,39 %)	(21,31 %)
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	0,99 %	0,98 %	0,81 %	0,62 %	2,80 %	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,38 %)	(0,28 %)	(0,13 %)	0,15 %	(2,10 %)	0,53 %
<b>31. Dezember 2021</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	19,88	15,00	13,95	–	17,68	18,49
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,09)	(0,07)	(0,04)	–	(0,45)	0,09
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	3,38	4,08	3,79	–	2,99	3,15
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,29	4,01	3,75	–	2,54	3,24
Schlussnettoinventarwert	23,17	19,01	17,70	–	20,22	21,73
Gesamtertrag	16,55 %	26,73 %	26,88 %	–	14,37 %	17,52 %
<b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>						
Aufwendungen <sup>++</sup>	1,05 %	1,05 %	0,87 %	–	2,98 %	0,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,41 %)	(0,39 %)	(0,25 %)	–	(2,35 %)	0,46 %



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse JPY I ¥	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Ausschüttende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD B US\$	Thesaurierende Klasse USD C2 US\$	Thesaurierende Klasse USD E US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	5,21	30,47	19,67	22,86	22,89	20,15
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,02)	(0,30)	(0,19)	(0,43)	(0,43)	(0,39)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(0,37)	(5,77)	(3,73)	(4,33)	(4,34)	(3,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,39)	(6,07)	(3,92)	(4,76)	(4,77)	(4,19)
Schlussnettoinventarwert	4,82	24,40	15,75	18,10	18,12	15,96
Gesamtertrag	(7,47 %)	(19,92 %)	(19,93 %)	(20,82 %)	(20,84 %)	(20,79 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,00 %	1,85 %	1,85 %	2,95 %	2,94 %	2,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,32 %)	(1,18 %)	(1,16 %)	(2,28 %)	(2,26 %)	(2,29 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	3,96	26,10	16,85	19,79	19,82	17,45
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,02)	(0,36)	(0,23)	(0,51)	(0,52)	(0,45)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,27	4,73	3,05	3,58	3,59	3,15
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,25	4,37	2,82	3,07	3,07	2,70
Schlussnettoinventarwert	5,21	30,47	19,67	22,86	22,89	20,15
Gesamtertrag	31,36 %	16,74 %	16,74 %	15,51 %	15,49 %	15,47 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,06 %	1,86 %	1,86 %	2,97 %	2,97 %	2,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,43 %)	(1,26 %)	(1,25 %)	(2,40 %)	(2,46 %)	(2,41 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Ausschüttende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I3 US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$	Thesaurierende Klasse USD T US\$	Thesaurierende Klasse USD Z US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	33,46	24,35	16.717,30	22,98	24,87	22,49
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,08)	(0,07)	7,33	(0,44)	(0,26)	0,10
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(6,36)	(4,62)	(3.190,05)	(4,31)	(4,72)	(4,27)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(6,44)	(4,69)	(3.182,72)	(4,75)	(4,98)	(4,17)
Schlussnettoinventarwert	27,02	19,66	13.534,58	18,23	19,89	18,32
Gesamtertrag	(19,25 %)	(19,26 %)	(19,04 %)	(20,67 %)	(20,02 %)	(18,54 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,00 %	1,00 %	0,73 %	2,85 %	1,95 %	0,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,29 %)	(0,32 %)	0,05 %	(2,28 %)	(1,25 %)	0,54 %

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	28,41	20,67	14.159,56	19,88	21,32	18,93
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,13)	(0,09)	(27,71)	(0,49)	(0,32)	0,10
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	5,18	3,77	2.585,45	3,59	3,87	3,46
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	5,05	3,68	2.557,74	3,10	3,55	3,56
Schlussnettoinventarwert	33,46	24,35	16.717,30	22,98	24,87	22,49
Gesamtertrag	17,78 %	17,80 %	18,06 %	15,59 %	16,65 %	18,81 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,01 %	1,01 %	0,76 %	2,87 %	1,97 %	0,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,41 %)	(0,39 %)	(0,18 %)	(2,28 %)	(1,39 %)	0,49 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
<b>31. Dezember 2022</b>		
Eröffnungsnettoinventarwert	279,01	230,55
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(5,60)	(2,62)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(46,82)	(38,81)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(52,42)	(41,43)
Schlussnettoinventarwert	226,59	189,12
Gesamtertrag	(18,79 %)	(17,97 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,06 %	2,02 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,36 %)	(1,32 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	231,92	189,73
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>		
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(6,74)	(3,18)
Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	53,83	44,00
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	47,09	40,82
Schlussnettoinventarwert	279,01	230,55
Gesamtertrag	20,30 %	21,51 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	3,20 %	2,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,61 %)	(1,50 %)

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap Intrinsic Value

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) £	Thesaurierende Klasse USD A US\$	Thesaurierende Klasse USD I US\$	Thesaurierende Klasse USD I2* US\$	Thesaurierende Klasse USD M US\$
<b>31. Dezember 2022</b>						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,24	10,40	24,28	21,17	10,00	20,38
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,04)	(0,02)	(0,25)	(0,07)	(0,01)	(0,39)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	(1,16)	(1,07)	(4,92)	(4,30)	(1,55)	(4,11)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,20)	(1,09)	(5,17)	(4,37)	(1,56)	(4,50)
Schlussnettoinventarwert	10,04	9,31	19,11	16,80	8,44	15,88
Gesamtertrag	(10,68 %)	(10,48 %)	(21,29 %)	(20,64 %)	(15,60 %)	(22,08 %)

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,03 %	0,85 %	1,85 %	1,00 %	0,83 %	2,85 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,37 %)	(0,21 %)	(1,25 %)	(0,40 %)	(0,18 %)	(2,25 %)

**31. Dezember 2021**

Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	19,38	16,76	–	16,43
<i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i>						
Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>	(0,06)	(0,01)	(0,36)	(0,15)	–	(0,50)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup>	1,30	0,41	5,26	4,56	–	4,45
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,24	0,40	4,90	4,41	–	3,95
Schlussnettoinventarwert	11,24	10,40	24,28	21,17	–	20,38
Gesamtertrag	12,40 %	4,00 %	25,28 %	26,31 %	–	24,04 %

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

Aufwendungen <sup>++</sup>	1,10 %	0,95 %	1,94 %	1,09 %	–	2,93 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,69 %)	(0,37 %)	(1,57 %)	(0,74 %)	–	(2,53 %)

<sup>+</sup> Berechnet auf Basis der durchschnittlichen Anzahl der im Berichtszeitraum im Umlauf befindlichen Anteile.

<sup>++</sup> Nach Abzug von etwaigen Kostenverzichten. Die Nettokostenquote enthält sowohl die betrieblichen als auch die nicht betrieblichen Kosten und alle erforderlichen Anpassungen, um die angemessenen Rechnungslegungsstandards zu erfüllen.

Die Kennziffern wurden, wo erforderlich, annualisiert.

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Die Teilfonds können Transaktionen in verschiedenen derivativen Instrumenten tätigen, u. a. in Swaptions, Devisenterminkontrakten, Futures-Kontrakten, Differenzkontrakten, umgekehrten Pensionsgeschäften sowie Aktien-, Index- und Währungsoptionskontrakten, Zins-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps, Inflation Swaps und Total Return Swaps.

Derivative Kontrakte sind in der Regel Bestandteil der Anlagestrategie der Teilfonds und werden in erster Linie eingesetzt, um Anlagen zu strukturieren und abzusichern, die Performance zu steigern und die Risiken der Teilfonds zu mindern (der Fonds erfasst keine Derivate als Absicherungsinstrumente zwecks Bilanzierung von Sicherungsgeschäften (Hedge Accounting)).

Der Fonds setzt derivative Finanzinstrumente ein, um seine Risiken wirtschaftlich abzusichern, und zwar in erster Linie das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko. Derivate können auch für Handelszwecke eingesetzt werden, wenn der Manager der Ansicht ist, dass dies effektiver ist als eine direkte Anlage in den zugrundeliegenden Finanzinstrumenten.

Derivate beinhalten bei ihrer Auflegung häufig nur ein wechselseitiges Versprechen, und es findet kein oder nur ein geringer Transfer einer konkreten Gegenleistung statt. Diese Instrumente sind jedoch häufig mit einer hohen Hebelwirkung (Leverage) verbunden und sind sehr volatil. Eine relativ geringfügige Veränderung beim Basiswert eines derivativen Kontrakts kann erhebliche Auswirkungen auf den Gewinn oder Verlust des Fonds haben.

Der Manager überwacht im Rahmen des allgemeinen Portfoliomanagements sorgfältig das Derivaterisiko der Teilfonds.

Der beizulegende Zeitwert dieser derivativen Instrumente wird in der Bilanz ausgewiesen, wobei die Veränderungen im beizulegenden Zeitwert unter dem Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen werden.

Die Teilfonds halten Devisenterminkontrakte, die für währungsgesicherte Anteilklassen spezifisch sind. Wechselkursschwankungen, die diese Devisenterminkontrakte beeinflussen, betreffen nur das Nettovermögen in der entsprechenden Klasse und nicht den Teilfonds als Ganzem. Weitere Informationen zu den Klassen der Devisenterminkontrakte finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestandes.

Die unten in der Tabelle aufgeführten Nennwerte gelten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 und geben einen Hinweis auf das Volumen der Derivate-Aktivitäten für das Jahr/den Zeitraum. Die Nennwerte geben keinen Hinweis auf das Markt- oder Kreditrisiko.

Devisenterminkontrakte	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
		Nennwert	Nennwert
5G Connectivity	USD	315.672.850	572.213.765
Absolute Return Multi Strategy*	USD	-	-
Asian Debt - Hard Currency	USD	3.526.442	2.412.426
China Bond	CNY	466.298.618	528.382.795
China Equity	USD	30.491.380	38.460.542
CLO Income	USD	76.412.170	76.145.742
Commodities <sup>1</sup>	USD	34.220.208	-
Corporate Hybrid Bond	EUR	1.362.463.245	1.873.456.407
Diversified Currency**	USD	-	-
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	1.673.599.864	2.343.472.791
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	1.436.786.755	2.299.640.476
Emerging Market Debt Blend	USD	403.481.714	817.198.857
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	59.461.234	46.648.343
Emerging Markets Equity	USD	41.179.268	57.167.120

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
		Nennwert	Nennwert
Euro Bond Absolute Return	EUR	30.393.822	14.104.734
European High Yield Bond	EUR	65.179.427	67.329.304
Event Driven <sup>1</sup>	USD	29.205.089	-
Global Bond	USD	98.358.364	123.743.668
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	9.331.213	11.845.316
Global Equity Index PutWrite*	USD	-	-
Global Flexible Credit Income	USD	705.321.007	687.056.465
Global High Yield SDG Engagement	USD	349.524.039	94.744.656
Global High Yield Sustainable Action	USD	5.642.133	4.951.817
Global Investment Grade Credit <sup>2</sup>	USD	24.960.937	31.266.661
Global Opportunistic Bond	USD	121.647.472	136.265.273
Global Real Estate Securities	USD	17.342.893	14.175.154
High Yield Bond	USD	1.349.607.844	1.688.510.358
InnovAsia 5G <sup>2</sup>	USD	9.698.871	12.916.297
Japan Equity Engagement	JPY	13.127.966.057	58.328.536
Macro Opportunities FX	EUR	219.491.178	269.337.750
Multi-Asset Income	USD	14.560.479	14.413.605
Multi-Style Premia***	USD	-	-
Next Generation Mobility	USD	7.949.517	8.044.747
Short Duration Emerging Market Debt	USD	4.086.532.395	5.063.620.247
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	400.764.403	468.294.715
Strategic Income	USD	566.633.760	727.228.979
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	USD	5.021.605	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	84.435.953	126.065.981
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	USD	145.143.252	-
Systematic Global Sustainable Value	USD	3.128.584	4.048.805
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	99.908.396	105.300.942
Uncorrelated Strategies	USD	6.286.016.234	5.314.403.377
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	1.330.232.992	-
US Equity	USD	36.487.253	-
US Equity Index PutWrite	USD	316.156.345	65.907.554
US Large Cap Value <sup>2</sup>	USD	20.699.861	-
US Long Short Equity	USD	115.952.786	284.026.164
US Multi Cap Opportunities	USD	68.451.167	92.798.334
US Real Estate Securities	USD	124.004.185	225.956.455
US Small Cap	USD	23.068.007	46.118.395
		<b>31. Dezember 2022</b>	<b>31. Dezember 2021</b>
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>	<b>Währung</b>	<b>Nennwert</b>	<b>Nennwert</b>
Corporate Hybrid Bond	EUR	37.445.575	-
Short Duration Emerging Market Debt	USD	1.843.240	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Differenzkontrakte****	Währung	31. Dezember 2022 Nennwert	31. Dezember 2021 Nennwert
Absolute Return Multi Strategy*	USD	-	6.171
Multi-Style Premia***	USD	-	-
Uncorrelated Strategies	USD	16.075.343.237	7.958.426.840
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	5.349.743.324	-
US Long Short Equity	USD	1.729.270	(535.372)

Optionskontrakte****	Währung	31. Dezember 2022 Nennwert	31. Dezember 2021 Nennwert
Global Equity Index PutWrite*	USD	-	-
Multi-Asset Income	USD	20.339.500	18.442.000
Multi-Style Premia***	USD	-	-
Uncorrelated Strategies	USD	764.870.377.121	223.934.735.861
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	116.969.966.645	-
US Equity Index PutWrite	USD	674.205.500	471.839.500
US Long Short Equity	USD	3.949.500	15.519.500

Futures-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2022 Nennwert	31. Dezember 2021 Nennwert
Absolute Return Multi Strategy*	USD	-	-
Asian Debt - Hard Currency	USD	3.925.584	4.088.786
China Bond	CNY	38.886.099	53.602.966
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	822.237.099	909.274.224
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	42.455.404	15.760.875
Emerging Market Debt Blend	USD	35.414.447	167.781.316
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	18.036.421	21.075.939
Euro Bond Absolute Return	EUR	35.660.318	27.680.050
Euro Opportunistic Bond	EUR	3.271.870	2.597.060
Global Bond	USD	35.754.749	37.383.417
Global Flexible Credit Income	USD	162.501.298	184.716.508
Global Opportunistic Bond	USD	51.243.234	95.373.915
Multi-Asset Income	USD	869.685	830.871
Multi-Style Premia***	USD	-	-
Strategic Income	USD	474.617.087	613.428.476
Sustainable Asia High Yield <sup>2</sup>	USD	937.591	3.308.016
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	7.688.938	14.828.471
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	USD	64.369.018	-
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	327.521.420	288.785.860
Uncorrelated Strategies	USD	9.826.365.666	16.688.841.641
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	2.525.719.173	-
US Long Short Equity	USD	13.179.449	77.480.814

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Zinsswap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
		Nennwert	Nennwert
Asian Debt - Hard Currency	USD	-	2.064.131
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	821.752.427	1.953.755.361
Emerging Market Debt Blend	USD	203.755.855	480.597.095
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	3.716.607	7.782.901
Euro Bond Absolute Return	EUR	2.700.000	9.205.373
Euro Opportunistic Bond	EUR	798.031	143.164
Global Bond	USD	7.904.541	4.110.547
Global Opportunistic Bond	USD	11.239.246	15.012.150
Strategic Income	USD	22.490.454	4.033.893
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	62.479.054	-
Uncorrelated Strategies	USD	44.778.595.660	13.057.439.809
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	7.934.771.768	-

Credit-Default-Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
		Nennwert	Nennwert
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	32.640.000	-
Emerging Market Debt Blend	USD	28.350.680	-
Euro Bond Absolute Return	EUR	3.000.000	4.000.000
Euro Opportunistic Bond	EUR	600.000	900.000
Global Bond	USD	2.972.291	-
Global Flexible Credit Income	USD	-	6.435.000
Global Opportunistic Bond	USD	13.727.919	13.843.135
Strategic Income	USD	13.175.213	15.915.000
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>1</sup>	USD	920.000	-
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	50.000.000	33.000.000
Uncorrelated Strategies	USD	61.521.538	4.889.960
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	4.323.083	-

Total Return Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
		Nennwert	Nennwert
CLO Income	USD	13.500.000	14.500.000
Commodities <sup>1</sup>	USD	84.753.608	-
Event Driven <sup>1</sup>	USD	38.432.156	-
Global Bond	USD	-	7.285.610
Global Flexible Credit Income	USD	25.001.730	48.504.400



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

		31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<b>Total Return Swap-Kontrakte****</b>	<b>Währung</b>	<b>Nennwert</b>	<b>Nennwert</b>
Global High Yield SDG Engagement	USD	37.950.000	-
High Yield Bond	USD	16.000.000	80.000.000
Multi-Asset Income	USD	-	46.437
Strategic Income	USD	126.680.000	120.600.000
Uncorrelated Strategies	USD	297.054.845	413.149.426
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	8.674.407	-
US Long Short Equity	USD	34.605.119	67.888.306

		31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<b>Swaptions</b>	<b>Währung</b>	<b>Nennwert</b>	<b>Nennwert</b>
Global Flexible Credit Income	USD	-	10.000.000
Uncorrelated Strategies	USD	1.632.559.980	18.111.000
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	256.139.995	-

		31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<b>Inflation Swap-Kontrakte****</b>	<b>Währung</b>	<b>Nennwert</b>	<b>Nennwert</b>
Euro Bond Absolute Return	EUR	10.997.950	1.600.000
Euro Opportunistic Bond	EUR	250.000	400.000
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	25.000.000	9.100.000
Uncorrelated Strategies	USD	623.548.271	-

		31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<b>Volatility-Swap-Kontrakte****</b>	<b>Währung</b>	<b>Nennwert</b>	<b>Nennwert</b>
Uncorrelated Strategies	USD	8.644.681.560	1.421.768.388
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	470.373.765	-

		31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<b>Variance-Swap-Kontrakte****</b>	<b>Währung</b>	<b>Nennwert</b>	<b>Nennwert</b>
Uncorrelated Strategies	USD	2.793.362	1.076.316
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	1.413.362	-

		31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<b>Correlation-Swap-Kontrakte****</b>	<b>Währung</b>	<b>Nennwert</b>	<b>Nennwert</b>
Uncorrelated Strategies	USD	13.270.000	4.270.000
XXXXXXXXXXXX <sup>1</sup>	USD	1.000.000	-

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

\*\*\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

\*\*\*\* Die angezeigten Beträge sind absolute Nennwerte.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr 2022 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)
5G Connectivity								
Devisenterminkontrakte	(34.344.868)	13.655.498	-	-	-	-	-	-
Absolute Return Multi Strategy*								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(7.199)	11.507	-	-
Asian Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	95.145	(53.507)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	227.141	52.911	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	3.333	(4.908)	-	-	-	-
China Bond								
Devisenterminkontrakte	21.788.314	1.834.914	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	397.557	376.843	-	-	-	-
China Equity								
Devisenterminkontrakte	(861.539)	353.434	-	-	-	-	-	-
CLO Income								
Devisenterminkontrakte	(9.039.612)	2.915.180	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(1.114.339)	(426.769)
Commodities <sup>2</sup>								
Devisenterminkontrakte	(1.341.444)	1.186.450	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(2.192.655)	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)
Corporate Hybrid Bond								
Devisenterminkontrakte	(15.809.097)	18.274.199	-	-	-	-	-	-
Emerging Market Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	(78.939.684)	(8.691.729)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	628.973	8.154.605	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(7.765.872)	1.909.636
Emerging Market Debt - Local Currency								
Devisenterminkontrakte	8.599.439	(3.428.586)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	3.755.166	(520.080)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(88.998.948)	1.486.967	-	-	-	-
Emerging Market Debt Blend								
Devisenterminkontrakte	(22.804.911)	(1.661.584)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	4.186.757	(381.781)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(19.525.431)	1.960.832	-	-	(1.050.415)	1.658.685
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend								
Devisenterminkontrakte	(1.082.921)	(403.699)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(286.000)	295.644	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(390.025)	51.099	-	-	7.490	-
Emerging Markets Equity								
Devisenterminkontrakte	(1.957.650)	597.444	-	-	-	-	-	-
Euro Bond Absolute Return								
Devisenterminkontrakte	2.236.954	(1.200.201)	-	-	-	-	-	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)
Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)								
Futures-Kontrakte	-	-	3.543.656	981.478	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	779.826	(206.284)	-	-	260.191	439.571
Euro Opportunistic Bond								
Futures-Kontrakte	-	-	108.706	(65.437)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	63.482	(44.999)	-	-	50.723	99.719
European High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	5.167.949	(2.310.995)	-	-	-	-	-	-
Event Driven <sup>2</sup>								
Devisenterminkontrakte	(13.858)	899.453	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	313.692	18.364
Global Bond								
Devisenterminkontrakte	(2.361.521)	400.741	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	609.985	431.813	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	428.391	23.192	-	-	150.351	(90.970)
Global Diversified Income FMP–2024								
Devisenterminkontrakte	(1.113.567)	576.942	-	-	-	-	-	-
Global Equity Megatrends								
Devisenterminkontrakte	(18)	-	-	-	-	-	-	-
Global Flexible Credit Income								
Devisenterminkontrakte	(68.588.731)	19.348.780	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	33.526.553	2.325.216	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(4.875.341)	(1.434.469)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)								
Swaptions	-	-	-	-	-	-	80.560	4.894
Global High Yield SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	(6.766.315)	3.781.363	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(4.592)	13.411
Global High Yield Sustainable Action								
Devisenterminkontrakte	778.395	(409.366)	-	-	-	-	-	-
Global Investment Grade Credit <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	4.793.821	(2.081.880)	-	-	-	-	-	-
Global Opportunistic Bond								
Devisenterminkontrakte	6.821.249	(3.237.790)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(1.155.660)	74.259	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(758)	30.702	-	-	835.892	2.024.541
Global Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	(2.134.514)	906.198	-	-	-	-	-	-
Global Sustainable Equity <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	13	-	-	-	-	-	-	-
High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	(74.656.641)	50.120.907	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(238.629)	(1.063.058)
InnovAsia 5G <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	(1.110.501)	484.488	-	-	-	-	-	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Japan Equity Engagement								
Devisenterminkontrakte	681.276.741	(97.210.699)	-	-	-	-	-	-
Macro Opportunities FX								
Devisenterminkontrakte	(1.503.902)	(18.792)	-	-	-	-	-	-
Multi-Asset Income								
Devisenterminkontrakte	916.535	(482.244)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	198.584	33.623	(9.147)	7.781	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	(468.909)	(38.953)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	194	(2.121)	-	-
Next Generation Mobility								
Devisenterminkontrakte	(808.298)	179.277	-	-	-	-	-	-
Short Duration Emerging Market Debt								
Devisenterminkontrakte	(403.920.805)	19.021.418	-	-	-	-	-	-
Short Duration High Yield SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	(55.455.517)	21.866.711	-	-	-	-	-	-
Strategic Income								
Devisenterminkontrakte	(74.954.126)	24.788.769	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	53.107.795	5.375.960	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(540.221)	(243.829)	-	-	(9.575.369)	(6.211.370)
Sustainable Asia High Yield <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	(3.848.434)	253.108	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	264.520	10.935	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Sustainable Emerging Market Corporate Debt								
Devisenterminkontrakte	(6.903.324)	262.510	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	2.013.756	(46.228)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(385)	-
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>2</sup>								
Devisenterminkontrakte	(3.200.125)	375.279	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(884.014)	2.466.299	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(258.198)	53.826
Systematic Global Sustainable Value								
Devisenterminkontrakte	(105.940)	45.453	-	-	-	-	-	-
Ultra Short Term Euro Bond								
Devisenterminkontrakte	15.556.930	(7.308.456)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	21.706.368	4.200.214	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	2.573.798	(2.325.045)	-	-	2.234.039	3.351.766
Uncorrelated Strategies								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(75.358.014)	(12.335.649)	-	-
Devisenterminkontrakte	(395.704.157)	191.661.278	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	65.592.148	1.797.289	289.296.178	32.243.865	25.921.705	(1.228.836)	-	-
Optionskontrakte	(4.841.697)	(89.564)	(47.455.691)	13.905.598	(10.770.042)	(6.431.124)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(34.100.737)	44.421.655	(6.250.384)	32.687.227	429.240	1.030.699
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(2.826.480)	337.180

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
XXXXXXXXXXXX <sup>2</sup>								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(86.214.611)	10.664.847	-	-
Devisenterminkontrakte	(49.448.101)	48.168.205	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	(4.908.877)	267.113	92.877.614	3.388.046	3.487.382	(55.918)	-	-
Optionskontrakte	2.464	31.049	(5.203.204)	5.862.351	(3.718.815)	(12.495.011)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(16.847)	23.822	(957.745)	1.055.312	220.296	(47.926)
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(779.292)	48.110
US Equity								
Devisenterminkontrakte	(2.263.323)	1.611.149	-	-	-	-	-	-
US Equity Index PutWrite								
Devisenterminkontrakte	(39.013.051)	14.321.515	-	-	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	(51.698.219)	(9.262.537)	-	-
US Large Cap Value <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	(551.371)	871.125	-	-	-	-	-	-
US Long Short Equity								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	9.575.763	2.406.289	-	-
Devisenterminkontrakte	(20.069.073)	9.726.320	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	252.059	234	9.712.450	1.232.318	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	48.013	(68.616)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	(1.409.044)	12.988.292	-	-
US Multi Cap Opportunities								
Devisenterminkontrakte	(4.218.776)	2.763.511	-	-	-	-	-	-



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)
US Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	(12.175.067)	5.848.700	-	-	-	-	-	-
US Small Cap								
Devisenterminkontrakte	(3.061.212)	1.174.184	-	-	-	-	-	-
US Small Cap Intrinsic Value								
Devisenterminkontrakte	1.730	-	-	-	-	-	-	-

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr 2021 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)
5G Connectivity								
Devisenterminkontrakte	(12.039.529)	(10.086.302)	-	-	-	-	-	-
Absolute Return Multi Strategy*								
Devisenterminkontrakte	(3.528.714)	(1.433.953)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	590.901	136.589	(75.360)	(40.774)	129.341	(12.893)	-	-
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(634.515)	(89.141)	-	-
Asian Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	(5.613)	(872)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	131.624	(10.577)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	9.299	5.136	-	-	-	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)
China Bond								
Devisenterminkontrakte	(9.185.684)	(8.783.890)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	1.721.550	(382.907)	-	-	-	-
China Equity								
Devisenterminkontrakte	(182.128)	(445.757)	-	-	-	-	-	-
CLO Income								
Devisenterminkontrakte	224.839	(2.333.159)	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	541.237	36.027
Corporate Hybrid Bond								
Devisenterminkontrakte	(15.920.907)	851.660	-	-	-	-	-	-
Diversified Currency*								
Devisenterminkontrakte	17.499	(14.828)	-	-	-	-	-	-
Emerging Market Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	(94.739.953)	1.605.908	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(26.106.064)	18.780.754	-	-	-	-
Emerging Market Debt - Local Currency								
Devisenterminkontrakte	(42.809.189)	(9.121.693)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	4.468.353	(389.452)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	102.277	(390.826)	37.915.362	(81.295.730)	-	-	-	-
Emerging Market Debt Blend								
Devisenterminkontrakte	(34.289.105)	(3.174.861)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	627.869	1.562.024	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	24.642	(94.161)	10.688.339	(21.201.302)	-	-	(1.251.335)	(1.210.775)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend								
Devisenterminkontrakte	(1.489.804)	501.477	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(96.417)	260.430	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	19.648	(127.505)	-	-	-	-
Emerging Markets Equity								
Devisenterminkontrakte	447.256	(1.264.193)	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Select Equity								
Devisenterminkontrakte	2.580	-	-	-	-	-	-	-
Euro Bond Absolute Return								
Devisenterminkontrakte	331.345	531.065	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	178.609	466.935	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	216.686	216.314	-	-	(22.300)	(472.208)
Euro Opportunistic Bond								
Futures-Kontrakte	-	-	13.425	28.389	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	6.273	24.777	-	-	(5.547)	(106.247)
European High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	546.398	1.387.321	-	-	-	-	-	-
Global Bond								
Devisenterminkontrakte	(1.543.683)	319.288	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	3.437.102	(295.984)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(741)	6.365	-	-	45.303	77.785

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Global Diversified Income FMP–2024								
Devisenterminkontrakte	153.336	(538.988)	-	-	-	-	-	-
Global Equity Index PutWrite								
Devisenterminkontrakte	(66.168)	(452.161)	-	-	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	2.288.799	298.490	-	-
Global Equity Megatrends								
Devisenterminkontrakte	(21)	-	-	-	-	-	-	-
Global Flexible Credit Income								
Devisenterminkontrakte	27.719.312	(27.406.105)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	5.299.104	(2.375.543)	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	56.000	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	2.316.140	500.200
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	(4.894)
Global High Yield SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	(569.118)	(868.823)	-	-	-	-	-	-
Global High Yield Sustainable Action								
Devisenterminkontrakte	90.378	186.986	-	-	-	-	-	-
Global Investment Grade Credit <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	714.042	455.185	-	-	-	-	-	-
Global Opportunistic Bond								
Devisenterminkontrakte	392.294	2.328.808	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	1.626.862	(223.274)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(2.010)	17.116	-	-	(363.956)	(1.647.480)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Global Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	(249.815)	(201.050)	-	-	-	-	-	-
Global Sustainable Equity <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	302	-	-	-	-	-	-	-
High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	53.652.655	(97.739.480)	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	3.443.147	(241.737)
InnovAsia 5G <sup>1</sup>								
Devisenterminkontrakte	(184.172)	(109.881)	-	-	-	-	-	-
Japan Equity Engagement								
Devisenterminkontrakte	225.294	526.794	-	-	-	-	-	-
Macro Opportunities FX								
Devisenterminkontrakte	747.592	174.508	-	-	-	-	-	-
Multi-Asset Income								
Devisenterminkontrakte	80.636	261.268	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(101.579)	17.779	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	472.808	14.543	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	2.779	2.121	-	-
Multi-Style Premia*								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(48.063)	33.360	-	-
Devisenterminkontrakte	19.692	(15.861)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	38.761	(25.470)	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	18.357	17.405	1.681	9.469

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Netto- gewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Next Generation Mobility								
Devisenterminkontrakte	(227.953)	(103.618)	-	-	-	-	-	-
Short Duration Emerging Market Debt								
Devisenterminkontrakte	(236.290.213)	(44.887.065)	-	-	-	-	-	-
Short Duration High Yield SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	(11.363.231)	(21.718.995)	-	-	-	-	-	-
Strategic Income								
Devisenterminkontrakte	(19.748.694)	(12.117.269)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	20.969.841	(4.984.565)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(57)	(519.590)	-	-	7.537.414	1.171.673
Sustainable Asia High Yield <sup>1</sup>								
Futures-Kontrakte	-	-	-	2.187	-	-	-	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt								
Devisenterminkontrakte	(6.866.921)	(379.695)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	401.332	60.710	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	8.001	-
Systematic Global Sustainable Value								
Devisenterminkontrakte	(39.991)	(53.390)	-	-	-	-	-	-
Ultra Short Term Euro Bond								
Devisenterminkontrakte	1.981.018	2.448.205	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(973.685)	3.705.306	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	628.192	515.395	-	-	272.915	(3.895.716)
Uncorrelated Strategies								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	43.225.923	5.421.473	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)
Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)								
Devisenterminkontrakte	16.646.016	(95.349.691)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	26.361.814	(314.547)	15.874.029	(13.973.312)	35.076.507	4.816.625	-	-
Optionskontrakte	(6.980.927)	(632.700)	-	-	(71.965.865)	(97.491.303)	-	-
Swap-Kontrakte	24.175	-	16.165.056	(2.385.740)	(8.775.576)	(691.584)	(391.434)	(220.090)
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(476.389)	(866.200)
US Equity Index PutWrite								
Devisenterminkontrakte	1.086.378	(388.906)	-	-	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	53.509.659	(1.103.238)	-	-
US Long Short Equity								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(11.116.589)	2.833.617	-	-
Devisenterminkontrakte	(7.990.655)	(9.870.992)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(78.465)	344	(18.991.369)	71.533	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	1.138.357	(647.339)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	(12.105.547)	(4.540.781)	-	-
US Multi Cap Opportunities								
Devisenterminkontrakte	302.759	(2.462.593)	-	-	-	-	-	-
US Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	(1.638.189)	(5.969.686)	-	-	-	-	-	-
US Small Cap								
Devisenterminkontrakte	(508.211)	(904.682)	-	-	-	-	-	-

\* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****26. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)****Bedingte Merkmale in Bezug auf das Kreditrisiko**

Die derivativen Kontrakte der Teilfonds unterliegen dem International Swaps and Derivatives Association Master Agreement (ISDA), das bestimmte Verpflichtungen und andere Bestimmungen enthält, wonach der Fonds möglicherweise zusätzliche Sicherheiten für Derivate stellen oder diese Kontrakte kündigen muss, wenn der Fonds nicht über eine ausreichende Anlagendeckung (Asset Coverage) für seine Kontrakte verfügt oder sein Nettovermögen um einen festgelegten Prozentsatz oder Betrag sinkt. Die Teilfonds gingen im Rahmen ihrer Anlagestrategien Credit Default Swaps ein, um sich gegen nachteilige Veränderungen im Wert von Anlagen abzusichern und sich vor nachteiligen Änderungen der Zinssätze oder der Kreditperformance von Gegenparteien zu schützen. Der maximale potenzielle Betrag, den die Teilfonds als Verkäufer eines Kreditschutzes eventuell zahlen müssen, wenn ein Kreditereignis eintritt, belief sich zum 31. Dezember 2022 auf 120.546.104 US\$ (31. Dezember 2021: 17.700.000 US\$). Die Summe des Zeitwerts aller Credit Default Swaps in Nettovermögensposition betrug zum 31. Dezember 2022 4.166.005 US\$ (31. Dezember 2021: (5.038.961) US\$). Der Fonds hielt zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 keine derivativen Instrumente mit bedingten Merkmalen in Bezug auf das Kreditrisiko.

**27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN**

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

Im Rahmen der finanziellen Berichterstattung nimmt der Fonds keine Saldierung von derivativen Vermögenswerten und derivativen Verbindlichkeiten in der Bilanz vor. Die folgenden Tabellen zeigen die außerbörslichen Derivategeschäfte (OTC-Derivate), Vermögenswerte aus Wertpapierleihgeschäften und Verbindlichkeiten des Fonds nach Gegenparteien, abzüglich von Beträgen, die im Rahmen eines Master Netting Agreements für eine Saldierung verfügbar sind, und abzüglich der zugehörigen Sicherheiten, die der Fonds zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 für Vermögenswerte erhalten hat und vom Fonds für Verbindlichkeiten hinterlegt wurden.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	12.141.765	(3.280.059)
<b>Insgesamt</b>	12.141.765	(3.280.059)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	541.183	(312.602)	-	228.581	(312.602)	312.602	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	(63.294)	-	-	(63.294)
State Street Bank and Trust Co	165.112	(165.112)	-	-	(610.428)	165.112	-	(445.316)
UBS AG	148.500	(148.500)	-	-	(315.586)	148.500	-	(167.086)
Westpac Banking Corp	11.286.970	(1.978.149)	-	9.308.821	(1.978.149)	1.978.149	-	-
<b>Insgesamt</b>	12.141.765	(2.604.363)	-	9.537.402	(3.280.059)	2.604.363	-	(675.696)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.155.281	(5.949.073)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.155.281</b>	<b>(5.949.073)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	2.713	(2.713)	-	-	(257.044)	2.713	-	(254.331)
Goldman Sachs International	226.597	(226.597)	-	-	(1.132.184)	226.597	-	(905.587)
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(3.913.846)	-	-	(3.913.846)
UBS AG	111.355	(107.845)	-	3.510	(107.845)	107.845	-	-
Westpac Banking Corp	814.616	(538.154)	-	276.462	(538.154)	538.154	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.155.281</b>	<b>(875.309)</b>	<b>-</b>	<b>279.972</b>	<b>(5.949.073)</b>	<b>875.309</b>	<b>-</b>	<b>(5.073.764)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Absolute Return Multi Strategy\*

31. Dezember 2022

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
OTC-Kontrakt	-	(11.507)
<b>Insgesamt</b>	-	(11.507)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(11.507)	-	-	(11.507)
<b>Insgesamt</b>	-	-	-	-	(11.507)	-	-	(11.507)

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Asian Debt - Hard Currency

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	34.382	(84.733)
<b>Insgesamt</b>	<b>34.382</b>	<b>(84.733)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
BNP Paribas	3.444	(1)	-	3.443	(1)	1	-	-
Citibank NA	2.050	(2.050)	-	-	(11.771)	2.050	-	(9.721)
Goldman Sachs International	10.822	-	-	10.822	-	-	-	-
JPMorgan Chase Bank	17.674	(17.674)	-	-	(29.242)	17.674	-	(11.568)
Morgan Stanley	392	(392)	-	-	(864)	392	-	(472)
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	(42.855)	-	-	(42.855)
<b>Insgesamt</b>	<b>34.382</b>	<b>(20.117)</b>	<b>-</b>	<b>14.265</b>	<b>(84.733)</b>	<b>20.117</b>	<b>-</b>	<b>(64.616)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	12.320	(9.164)
OTC-Kontrakt	-	(3)
<b>Insgesamt</b>	<b>12.320</b>	<b>(9.167)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>
BNP Paribas	3.630	(2.256)	-	1.374	(2.256)	2.256	-	-
Citibank NA	2.914	(720)	-	2.194	(720)	720	-	-
Goldman Sachs International	-	-	-	-	(578)	-	-	(578)
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(3.013)	-	-	(3.013)
Morgan Stanley	-	-	-	-	(903)	-	-	(903)
Standard Chartered Bank	5.759	(1.672)	-	4.087	(1.672)	1.672	-	-
Westpac Banking Corp	17	(17)	-	-	(25)	17	-	(8)
<b>Insgesamt</b>	<b>12.320</b>	<b>(4.665)</b>	<b>-</b>	<b>7.655</b>	<b>(9.167)</b>	<b>4.665</b>	<b>-</b>	<b>(4.502)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	CNY	CNY
Devisenterminkontrakte	3.921.557	(2.701.843)
<b>Insgesamt</b>	<b>3.921.557</b>	<b>(2.701.843)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten CNY	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY
Citibank NA	68.042	(68.042)	-	-	(156.782)	68.042	-	(88.740)
Goldman Sachs International	1.680.891	-	-	1.680.891	-	-	-	-
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(2.520.269)	-	-	(2.520.269)
Standard Chartered Bank	1.992.935	-	-	1.992.935	-	-	-	-
UBS AG	162.642	(24.648)	-	137.994	(24.648)	24.648	-	-
Westpac Banking Corp	17.047	(144)	-	16.903	(144)	144	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>3.921.557</b>	<b>(92.834)</b>	<b>-</b>	<b>3.828.723</b>	<b>(2.701.843)</b>	<b>92.834</b>	<b>-</b>	<b>(2.609.009)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	CNY	CNY
Devisenterminkontrakte	2.173.424	(2.788.624)
<b>Insgesamt</b>	<b>2.173.424</b>	<b>(2.788.624)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten CNY	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY
Citibank NA	124.955	-	-	124.955	-	-	-	-
Goldman Sachs International	316.292	(54.265)	-	262.027	(54.265)	54.265	-	-
JPMorgan Chase Bank	373.432	(373.432)	-	-	(883.609)	373.432	-	(510.177)
Standard Chartered Bank	236.105	(136.490)	-	99.615	(136.490)	136.490	-	-
UBS AG	638.456	(638.456)	-	-	(1.280.756)	638.456	-	(642.300)
Westpac Banking Corp	484.184	(433.504)	-	50.680	(433.504)	433.504	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>2.173.424</b>	<b>(1.636.147)</b>	<b>-</b>	<b>537.277</b>	<b>(2.788.624)</b>	<b>1.636.147</b>	<b>-</b>	<b>(1.152.477)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.099.861	(817.712)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.099.861</b>	<b>(817.712)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	16.443	(16.443)	-	-	(20.824)	16.443	-	(4.381)
UBS AG	3.274	(3.274)	-	-	(22.277)	3.274	-	(19.003)
Westpac Banking Corp	1.080.144	(774.611)	-	305.533	(774.611)	774.611	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.099.861</b>	<b>(794.328)</b>	<b>-</b>	<b>305.533</b>	<b>(817.712)</b>	<b>794.328</b>	<b>-</b>	<b>(23.384)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	196.873	(268.158)
<b>Insgesamt</b>	<b>196.873</b>	<b>(268.158)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	71.084	(71.084)	-	-	(98.993)	71.084	-	(27.909)
UBS AG	54.809	(54.809)	-	-	(74.017)	54.809	-	(19.208)
Westpac Banking Corp	70.980	(70.980)	-	-	(95.148)	70.980	-	(24.168)
<b>Insgesamt</b>	<b>196.873</b>	<b>(196.873)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(268.158)</b>	<b>196.873</b>	<b>-</b>	<b>(71.285)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	3.267.421	(989.846)
OTC-Kontrakt	-	(334.323)
<b>Insgesamt</b>	3.267.421	(1.324.169)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	16.221	(16.221)	-	-	(334.558)	16.221	318.337	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(760.209)	-	-	(760.209)
UBS AG	1.109.111	-	-	1.109.111	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	2.142.089	(229.402)	-	1.912.687	(229.402)	229.402	-	-
<b>Insgesamt</b>	3.267.421	(245.623)	-	3.021.798	(1.324.169)	245.623	318.337	(760.209)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	60.610	(698.215)
OTC-Kontrakt	92.446	-
<b>Insgesamt</b>	<b>153.056</b>	<b>(698.215)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	2.837	(2.837)	-	-	(181.488)	2.837	-	(178.651)
Goldman Sachs International	95.962	(95.962)	-	-	(235.777)	95.962	-	(139.815)
State Street Bank and Trust Co	14.793	-	-	14.793	-	-	-	-
UBS AG	8.662	-	-	8.662	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	30.802	(30.802)	-	-	(280.950)	30.802	-	(250.148)
<b>Insgesamt</b>	<b>153.056</b>	<b>(129.601)</b>	<b>-</b>	<b>23.455</b>	<b>(698.215)</b>	<b>129.601</b>	<b>-</b>	<b>(568.614)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Commodities<sup>1</sup>

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.519.496	(333.046)
<b>Insgesamt</b>	1.519.496	(333.046)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Standard Chartered Bank	1.312.734	(19.921)	-	1.292.813	(19.921)	19.921	-	-
State Street Bank and Trust Co	23.465	(23.465)	-	-	(75.175)	23.465	-	(51.710)
Westpac Banking Corp	183.297	(183.297)	-	-	(237.950)	183.297	-	(54.653)
<b>Insgesamt</b>	1.519.496	(226.683)	-	1.292.813	(333.046)	226.683	-	(106.363)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	36.511.573	(20.223.334)
<b>Insgesamt</b>	<b>36.511.573</b>	<b>(20.223.334)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR
Goldman Sachs International	944.612	(775.751)	-	168.861	(775.751)	775.751	-	-
UBS AG	3.550.212	(686.746)	-	2.863.466	(686.746)	686.746	-	-
Westpac Banking Corp	32.016.749	(18.760.837)	-	13.255.912	(18.760.837)	18.760.837	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>36.511.573</b>	<b>(20.223.334)</b>	<b>-</b>	<b>16.288.239</b>	<b>(20.223.334)</b>	<b>20.223.334</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	13.732.395	(15.718.355)
Wertpapierleihe	8.635.753	-
<b>Insgesamt</b>	<b>22.368.148</b>	<b>(15.718.355)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR
Brown Brothers Harriman	8.635.753	-	-	(8.635.753)	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International	4.660.298	(4.660.298)	-	-	-	(9.380.383)	4.660.298	-	(4.720.085)
UBS AG	4.135.976	(4.135.976)	-	-	-	(4.924.964)	4.135.976	-	(788.988)
Westpac Banking Corp	4.936.121	(1.413.008)	-	-	3.523.113	(1.413.008)	1.413.008	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>22.368.148</b>	<b>(10.209.282)</b>	<b>-</b>	<b>(8.635.753)</b>	<b>3.523.113</b>	<b>(15.718.355)</b>	<b>10.209.282</b>	<b>-</b>	<b>(5.509.073)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	12.379.899	(10.560.096)
<b>Insgesamt</b>	<b>12.379.899</b>	<b>(10.560.096)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	-	(35.687)	-	-	(35.687)
Goldman Sachs International	89.565	(89.565)	-	-	-	(765.905)	89.565	-	(676.340)
HSBC Bank Plc	-	-	-	-	-	(109.096)	-	-	(109.096)
UBS AG	9.726.057	(8.242.559)	-	-	1.483.498	(8.242.559)	8.242.559	-	-
Westpac Banking Corp	2.564.277	(1.406.849)	-	-	1.157.428	(1.406.849)	1.406.849	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>12.379.899</b>	<b>(9.738.973)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2.640.926</b>	<b>(10.560.096)</b>	<b>9.738.973</b>	<b>-</b>	<b>(821.123)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	12.483.572	(1.972.040)
Wertpapierleihe	1.369.293	-
<b>Insgesamt</b>	<b>13.852.865</b>	<b>(1.972.040)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	
Brown Brothers Harriman	1.369.293	-	-	(1.369.293)	-	-	-	-	-	
Citibank NA	-	-	-	-	-	(1.228)	-	-	(1.228)	
Deutsche Bank AG	5.292.868	-	-	-	5.292.868	-	-	-	-	
Goldman Sachs International	3.380.170	(1.255.498)	-	-	2.124.672	(1.255.498)	1.255.498	-	-	
JPMorgan Chase Bank	135.538	(135.538)	-	-	-	(160.935)	135.538	-	(25.397)	
UBS AG	2.150.408	(300.205)	-	-	1.850.203	(300.205)	300.205	-	-	
Westpac Banking Corp	1.524.588	(254.174)	-	-	1.270.414	(254.174)	254.174	-	-	
<b>Insgesamt</b>	<b>13.852.865</b>	<b>(1.945.415)</b>	<b>-</b>	<b>(1.369.293)</b>	<b>10.538.157</b>	<b>(1.972.040)</b>	<b>1.945.415</b>	<b>-</b>	<b>(26.625)</b>	



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US\$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US\$
Devisenterminkontrakte	14.987.459	(9.665.447)
OTC-Kontrakt	734.076	(2.207.907)
<b>Insgesamt</b>	<b>15.721.535</b>	<b>(11.873.354)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	380.673	(380.673)	-	-	(1.344.347)	380.673	-	(963.674)
BNP Paribas	393.015	(393.015)	-	-	(472.729)	393.015	-	(79.714)
Brown Brothers Harriman	34.283	-	-	34.283	-	-	-	-
Citibank NA	2.888.351	(1.791.727)	-	1.096.624	(1.791.727)	1.791.727	-	-
Deutsche Bank AG	577.311	-	-	577.311	-	-	-	-
Goldman Sachs International	5.189.853	(3.515.469)	(1.674.384)	-	(3.515.469)	3.515.469	-	-
HSBC Bank Plc	229.243	(229.243)	-	-	(740.115)	229.243	370.000	(140.872)
JPMorgan Chase Bank	2.456.371	(2.456.371)	-	-	(2.956.556)	2.456.371	500.185	-
Morgan Stanley	1.113.150	(45.688)	(1.000.000)	67.462	(45.688)	45.688	-	-
Standard Chartered Bank	740.156	(198)	-	739.958	(198)	198	-	-
State Street Bank and Trust Co	91.230	(91.230)	-	-	(748.662)	91.230	510.000	(147.432)
UBS AG	1.205.891	(241.117)	-	964.774	(241.117)	241.117	-	-
Westpac Banking Corp	422.008	(16.746)	-	405.262	(16.746)	16.746	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>15.721.535</b>	<b>(9.161.477)</b>	<b>(2.674.384)</b>	<b>3.885.674</b>	<b>(11.873.354)</b>	<b>9.161.477</b>	<b>1.380.185</b>	<b>(1.331.692)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	16.632.554	(7.881.956)
OTC-Kontrakt	1.767.099	(11.559.883)
<b>Insgesamt</b>	<b>18.399.653</b>	<b>(19.441.839)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	911.623	-	-	911.623	-	-	-	-
BNP Paribas	14.651	-	-	14.651	-	-	-	-
Citibank NA	4.030.149	(2.016.046)	(1.560.000)	454.103	(2.016.046)	2.016.046	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(34.495)	-	-	(34.495)
Goldman Sachs International	5.748.350	(5.748.350)	-	-	(10.622.356)	5.748.350	4.490.000	(384.006)
HSBC Bank Plc	2.075.394	(870.810)	(1.070.000)	134.584	(870.810)	870.810	-	-
JPMorgan Chase Bank	942.995	(942.995)	-	-	(4.369.359)	942.995	3.426.364	-
Morgan Stanley	3.566.753	(748.597)	(2.570.000)	248.156	(748.597)	748.597	-	-
Standard Chartered Bank	780.498	(683.372)	(97.126)	-	(683.372)	683.372	-	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(11.731)	-	-	(11.731)
UBS AG	290.584	(28.303)	-	262.281	(28.303)	28.303	-	-
Westpac Banking Corp	38.656	(38.656)	-	-	(56.770)	38.656	-	(18.114)
<b>Insgesamt</b>	<b>18.399.653</b>	<b>(11.077.129)</b>	<b>(5.297.126)</b>	<b>2.025.398</b>	<b>(19.441.839)</b>	<b>11.077.129</b>	<b>7.916.364</b>	<b>(448.346)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	4.031.358	(2.058.976)
OTC-Kontrakt	938.323	(678.507)
<b>Insgesamt</b>	<b>4.969.681</b>	<b>(2.737.483)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	44.223	(18.841)	-	25.382	(18.841)	18.841	-	-
Citibank NA	521.190	(295.375)	-	225.815	(295.375)	295.375	-	-
Deutsche Bank AG	102.206	-	-	102.206	-	-	-	-
Goldman Sachs International	1.657.848	(836.696)	(770.000)	51.152	(836.696)	836.696	-	-
HSBC Bank Plc	62.182	(62.182)	-	-	(126.410)	62.182	-	(64.228)
JPMorgan Chase Bank	370.316	(370.316)	-	-	(638.040)	370.316	220.000	(47.724)
Morgan Stanley	257.955	(2.938)	(70.000)	185.017	(2.938)	2.938	-	-
Standard Chartered Bank	3.397	(3.397)	-	-	(7.546)	3.397	-	(4.149)
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(125.834)	-	-	(125.834)
UBS AG	23.750	(23.750)	-	-	(492.423)	23.750	-	(468.673)
Westpac Banking Corp	1.926.614	(193.380)	-	1.733.234	(193.380)	193.380	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>4.969.681</b>	<b>(1.806.875)</b>	<b>(840.000)</b>	<b>2.322.806</b>	<b>(2.737.483)</b>	<b>1.806.875</b>	<b>220.000</b>	<b>(710.608)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US\$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US\$
Devisenterminkontrakte	5.585.915	(1.951.949)
OTC-Kontrakt	1.074.644	(2.369.342)
<b>Insgesamt</b>	<b>6.660.559</b>	<b>(4.321.291)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	251.772	(15.416)	-	236.356	(15.416)	15.416	-	-
BNP Paribas	3.834	(3.834)	-	-	(16.802)	3.834	-	(12.968)
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	(25.176)	-	-	(25.176)
Citibank NA	816.639	(451.558)	(210.000)	155.081	(451.558)	451.558	-	-
Deutsche Bank AG	89.756	(17.869)	-	71.887	(17.869)	17.869	-	-
Goldman Sachs International	2.365.270	(2.071.309)	(120.000)	173.961	(2.071.309)	2.071.309	-	-
HSBC Bank Plc	367.431	(218.687)	-	148.744	(218.687)	218.687	-	-
JPMorgan Chase Bank	219.790	(219.790)	-	-	(992.127)	219.790	772.337	-
Morgan Stanley	1.009.919	(209.271)	(710.000)	90.648	(209.271)	209.271	-	-
Standard Chartered Bank	540.438	(191.270)	-	349.168	(191.270)	191.270	-	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(3.537)	-	-	(3.537)
UBS AG	489.858	(22.424)	-	467.434	(22.424)	22.424	-	-
Westpac Banking Corp	505.852	(85.845)	-	420.007	(85.845)	85.845	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>6.660.559</b>	<b>(3.507.273)</b>	<b>(1.040.000)</b>	<b>2.113.286</b>	<b>(4.321.291)</b>	<b>3.507.273</b>	<b>772.337</b>	<b>(41.681)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	446.879	(340.697)
<b>Insgesamt</b>	446.879	(340.697)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	4.647	(1.063)	-	3.584	(1.063)	1.063	-	-
BNP Paribas	112.720	(3.562)	-	109.158	(3.562)	3.562	-	-
Citibank NA	28.911	(28.911)	-	-	(41.714)	28.911	-	(12.803)
Deutsche Bank AG	7.148	(489)	-	6.659	(489)	489	-	-
Goldman Sachs International	173.055	(17.275)	-	155.780	(17.275)	17.275	-	-
HSBC Bank Plc	7.242	(7.242)	-	-	(10.109)	7.242	-	(2.867)
JPMorgan Chase Bank	29.037	(26.319)	-	2.718	(26.319)	26.319	-	-
Morgan Stanley	10.524	(4.456)	-	6.068	(4.456)	4.456	-	-
Standard Chartered Bank	2.657	(2.657)	-	-	(204.043)	2.657	-	(201.386)
State Street Bank and Trust Co	1.798	(479)	-	1.319	(479)	479	-	-
Westpac Banking Corp	69.140	(31.188)	-	37.952	(31.188)	31.188	-	-
<b>Insgesamt</b>	446.879	(123.641)	-	323.238	(340.697)	123.641	-	(217.056)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	606.096	(96.215)
OTC-Kontrakt	-	(88.192)
<b>Insgesamt</b>	606.096	(184.407)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	116	-	-	116	-	-	-	-
BNP Paribas	191.549	-	-	191.549	-	-	-	-
Citibank NA	11.452	(11.452)	-	-	(17.160)	11.452	-	(5.708)
Deutsche Bank AG	6.064	-	-	6.064	-	-	-	-
Goldman Sachs International	296.373	(91.694)	-	204.679	(91.694)	91.694	-	-
HSBC Bank Plc	11.871	(11.871)	-	-	(29.396)	11.871	-	(17.525)
JPMorgan Chase Bank	13.347	(13.347)	-	-	(25.006)	13.347	-	(11.659)
Morgan Stanley	4.599	(4.108)	-	491	(4.108)	4.108	-	-
Standard Chartered Bank	70.724	(17.008)	-	53.716	(17.008)	17.008	-	-
State Street Bank and Trust Co	1	(1)	-	-	(35)	1	-	(34)
<b>Insgesamt</b>	606.096	(149.481)	-	456.615	(184.407)	149.481	-	(34.926)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.053.813	(666.859)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.053.813</b>	<b>(666.859)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	223.814	(139.085)	-	84.729	(139.085)	139.085	-	-
Royal Bank of Canada	567	(567)	-	-	(2.673)	567	-	(2.106)
UBS AG	21.918	(10.004)	-	11.914	(10.004)	10.004	-	-
Westpac Banking Corp	807.514	(515.097)	-	292.417	(515.097)	515.097	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.053.813</b>	<b>(664.753)</b>	<b>-</b>	<b>389.060</b>	<b>(666.859)</b>	<b>664.753</b>	<b>-</b>	<b>(2.106)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	478.323	(688.813)
Wertpapierleihe	917.277	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.395.600</b>	<b>(688.813)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup>	Netto- betrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Brown Brothers Harriman	917.277	-	-	(917.277)	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International	99.671	(99.671)	-	-	-	(231.658)	99.671	-	(131.987)
UBS AG	74.860	(74.860)	-	-	-	(200.353)	74.860	-	(125.493)
Westpac Banking Corp	303.792	(256.802)	-	-	46.990	(256.802)	256.802	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.395.600</b>	<b>(431.333)</b>	<b>-</b>	<b>(917.277)</b>	<b>46.990</b>	<b>(688.813)</b>	<b>431.333</b>	<b>-</b>	<b>(257.480)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Select Equity

31. Dezember 2022

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Wertpapierleihe	1.014.757	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.014.757</b>	<b>-</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	
Brown Brothers Harriman	1.014.757	-	-	(1.014.757)	-	-	-	-	-	
<b>Insgesamt</b>	<b>1.014.757</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1.014.757)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	39.745	(1.032.074)
<b>Insgesamt</b>	39.745	(1.032.074)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR
Goldman Sachs International	608	(608)	-	-	(10.898)	608	-	(10.290)
Standard Chartered Bank	5.615	(5.615)	-	-	(29.576)	5.615	-	(23.961)
State Street Bank and Trust Co	17.588	(5.247)	-	12.341	(5.247)	5.247	-	-
Westpac Banking Corp	15.934	(15.934)	-	-	(986.353)	15.934	-	(970.419)
<b>Insgesamt</b>	39.745	(27.404)	-	12.341	(1.032.074)	27.404	-	(1.004.670)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	221.198	(13.326)
Wertpapierleihe	295.609	-
<b>Insgesamt</b>	<b>516.807</b>	<b>(13.326)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	
BNP Paribas	7.964	-	-	-	7.964	-	-	-	-	
Brown Brothers Harriman	295.609	-	-	(295.609)	-	-	-	-	-	
Citibank NA	61.586	-	-	-	61.586	-	-	-	-	
Deutsche Bank AG	14	-	-	-	14	-	-	-	-	
Goldman Sachs International	76.265	-	-	-	76.265	-	-	-	-	
JP Morgan Chase Bank	-	-	-	-	-	(13.326)	-	-	(13.326)	
Westpac Banking Corp	75.369	-	-	-	75.369	-	-	-	-	
<b>Insgesamt</b>	<b>516.807</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(295.609)</b>	<b>221.198</b>	<b>(13.326)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(13.326)</b>	

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	1.258.544	(3.113.019)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.258.544</b>	<b>(3.113.019)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Goldman Sachs International	20.066	(20.066)	-	-	-	(39.074)	20.066	-	(19.008)
UBS AG	35.438	(16.930)	-	-	18.508	(16.930)	16.930	-	-
Westpac Banking Corp	1.203.040	(1.203.040)	-	-	-	(3.057.015)	1.203.040	-	(1.853.975)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.258.544</b>	<b>(1.240.036)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>18.508</b>	<b>(3.113.019)</b>	<b>1.240.036</b>	<b>-</b>	<b>(1.872.983)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	777.070	(320.550)
Wertpapierleihe	734.967	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.512.037</b>	<b>(320.550)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	
Brown Brothers Harriman	734.967	-	-	(734.967)	-	-	-	-	-	
Goldman Sachs International	250.455	(82.968)	-	-	167.487	(82.968)	82.968	-	-	
UBS AG	203.498	(69.497)	-	-	134.001	(69.497)	69.497	-	-	
Westpac Banking Corp	323.117	(168.085)	-	-	155.032	(168.085)	168.085	-	-	
<b>Insgesamt</b>	<b>1.512.037</b>	<b>(320.550)</b>	<b>-</b>	<b>(734.967)</b>	<b>456.520</b>	<b>(320.550)</b>	<b>320.550</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven<sup>1</sup>

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	918.069	(18.616)
OTC-Kontrakt	18.364	-
<b>Insgesamt</b>	<b>936.433</b>	<b>(18.616)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
Morgan Stanley	18.364	-	-	18.364	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	918.069	(18.616)	-	899.453	(18.616)	18.616	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>936.433</b>	<b>(18.616)</b>	<b>-</b>	<b>917.817</b>	<b>(18.616)</b>	<b>18.616</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Bond

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	2.638.428	(1.908.377)
<b>Insgesamt</b>	<b>2.638.428</b>	<b>(1.908.377)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup>	Nettobetrag <sup>(b)</sup>
	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$	US\$
BNP Paribas	442.935	(217.047)	-	225.888	(217.047)	217.047	-	-
Goldman Sachs International	120.460	(120.460)	-	-	(615.311)	120.460	280.000	(214.851)
Royal Bank of Canada	30.889	(30.889)	-	-	(55.928)	30.889	-	(25.039)
Société Générale	28.962	(28.962)	-	-	(161.628)	28.962	-	(132.666)
Standard Chartered Bank	1.202.093	(124.265)	-	1.077.828	(124.265)	124.265	-	-
State Street Bank and Trust Co	203.836	(61.874)	-	141.962	(61.874)	61.874	-	-
UBS AG	381.622	(381.622)	-	-	(528.995)	381.622	-	(147.373)
Westpac Banking Corp	227.631	(143.329)	-	84.302	(143.329)	143.329	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>2.638.428</b>	<b>(1.108.448)</b>	<b>-</b>	<b>1.529.980</b>	<b>(1.908.377)</b>	<b>1.108.448</b>	<b>280.000</b>	<b>(519.929)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.109.117	(779.807)
OTC-Kontrakt	77.785	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.186.902</b>	<b>(779.807)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
BNP Paribas	79.212	(79.212)	-	-	(132.044)	79.212	-	(52.832)
Citibank NA	249.215	(103.993)	-	145.222	(103.993)	103.993	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(1.983)	-	-	(1.983)
Goldman Sachs International	16.930	(16.930)	-	-	(24.738)	16.930	-	(7.808)
Royal Bank of Canada	17.878	(17.878)	-	-	(26.402)	17.878	-	(8.524)
Société Générale	84.724	(10.306)	-	74.418	(10.306)	10.306	-	-
Standard Chartered Bank	253.987	(253.987)	-	-	(328.987)	253.987	-	(75.000)
State Street Bank and Trust Co	79.421	(73.726)	-	5.695	(73.726)	73.726	-	-
UBS AG	371.661	(77.612)	-	294.049	(77.612)	77.612	-	-
Westpac Banking Corp	33.874	(16)	-	33.858	(16)	16	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.186.902</b>	<b>(633.660)</b>	<b>-</b>	<b>553.242</b>	<b>(779.807)</b>	<b>633.660</b>	<b>-</b>	<b>(146.147)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	523.987	(417)
<b>Insgesamt</b>	<b>523.987</b>	<b>(417)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
State Street Bank and Trust Co	34	-	-	34	-	-	-	-
UBS AG	3.888	-	-	3.888	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	520.065	(417)	-	519.648	(417)	417	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>523.987</b>	<b>(417)</b>	<b>-</b>	<b>523.570</b>	<b>(417)</b>	<b>417</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	23.493	(76.865)
<b>Insgesamt</b>	<b>23.493</b>	<b>(76.865)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	350	(350)	-	-	(2.210)	350	-	(1.860)
Goldman Sachs International	85	(85)	-	-	(17.506)	85	-	(17.421)
State Street Bank and Trust Co	9	-	-	9	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	23.049	(23.049)	-	-	(57.149)	23.049	-	(34.100)
<b>Insgesamt</b>	<b>23.493</b>	<b>(23.484)</b>	<b>-</b>	<b>9</b>	<b>(76.865)</b>	<b>23.484</b>	<b>-</b>	<b>(53.381)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	29.033.515	(10.857.921)
OTC-Kontrakt	-	(632.100)
<b>Insgesamt</b>	<b>29.033.515</b>	<b>(11.490.021)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	521.466	(521.466)	-	-	(657.911)	521.466	-	(136.445)
JPMorgan Chase Bank	154.429	(154.429)	-	-	(604.889)	154.429	760.000	309.540
State Street Bank and Trust Co	25.713.338	(5.911.810)	-	19.801.528	(5.911.810)	5.911.810	-	-
Westpac Banking Corp	2.644.282	(2.644.282)	-	-	(4.315.411)	2.644.282	-	(1.671.129)
<b>Insgesamt</b>	<b>29.033.515</b>	<b>(9.231.987)</b>	<b>-</b>	<b>19.801.528</b>	<b>(11.490.021)</b>	<b>9.231.987</b>	<b>760.000</b>	<b>(1.498.034)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.927.621	(3.100.807)
OTC-Kontrakt	214.191	-
<b>Insgesamt</b>	<b>2.141.812</b>	<b>(3.100.807)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	11	(11)	-	-	(836.111)	11	-	(836.100)
Goldman Sachs International	12.153	(12.153)	-	-	(1.118.246)	12.153	-	(1.106.093)
JPMorgan Chase Bank	1.690.523	(2.000)	(250.000)	1.438.523	(2.000)	2.000	-	-
State Street Bank and Trust Co	193.559	-	-	193.559	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	245.566	(245.566)	-	-	(1.144.450)	245.566	-	(898.884)
<b>Insgesamt</b>	<b>2.141.812</b>	<b>(259.730)</b>	<b>(250.000)</b>	<b>1.632.082</b>	<b>(3.100.807)</b>	<b>259.730</b>	<b>-</b>	<b>(2.841.077)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	12.873.530	(9.426.254)
OTC-Kontrakt	13.411	-
<b>Insgesamt</b>	<b>12.886.941</b>	<b>(9.426.254)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	43.567	(43.567)	-	-	(84.265)	43.567	-	(40.698)
UBS AG	503.272	(74)	-	503.198	(74)	74	-	-
Westpac Banking Corp	12.340.102	(9.341.915)	-	2.998.187	(9.341.915)	9.341.915	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>12.886.941</b>	<b>(9.385.556)</b>	<b>-</b>	<b>3.501.385</b>	<b>(9.426.254)</b>	<b>9.385.556</b>	<b>-</b>	<b>(40.698)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	617.850	(951.937)
Wertpapierleihe	150.480	-
<b>Insgesamt</b>	<b>768.330</b>	<b>(951.937)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Netto- betrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Brown Brothers Harriman	150.480	-	-	(150.480)	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International	180.599	(180.599)	-	-	-	(328.717)	180.599	-	(148.118)
UBS AG	125.671	(125.671)	-	-	-	(261.202)	125.671	-	(135.531)
Westpac Banking Corp	311.580	(311.580)	-	-	-	(362.018)	311.580	-	(50.438)
<b>Insgesamt</b>	<b>768.330</b>	<b>(617.850)</b>	<b>-</b>	<b>(150.480)</b>	<b>-</b>	<b>(951.937)</b>	<b>617.850</b>	<b>-</b>	<b>(334.087)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	7.620	(358.029)
<b>Insgesamt</b>	<b>7.620</b>	<b>(358.029)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(356.484)	-	-	(356.484)
Westpac Banking Corp	7.620	(1.545)	-	6.075	(1.545)	1.545	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>7.620</b>	<b>(1.545)</b>	<b>-</b>	<b>6.075</b>	<b>(358.029)</b>	<b>1.545</b>	<b>-</b>	<b>(356.484)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	69.215	(10.258)
<b>Insgesamt</b>	69.215	(10.258)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
State Street Bank and Trust Co	69.215	(7.370)	-	61.845	(7.370)	7.370	-	-
UBS AG	-	-	-	-	(173)	-	-	(173)
Westpac Banking Corp	-	-	-	-	(2.715)	-	-	(2.715)
<b>Insgesamt</b>	69.215	(7.370)	-	61.845	(10.258)	7.370	-	(2.888)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	16.124	(1.642.819)
<b>Insgesamt</b>	16.124	(1.642.819)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
JPMorgan Chase Bank	12.361	(1.985)	-	10.376	(1.985)	1.985	-	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(1.350.854)	-	-	(1.350.854)
UBS AG	-	-	-	-	(289.980)	-	-	(289.980)
Westpac Banking Corp	3.763	-	-	3.763	-	-	-	-
<b>Insgesamt</b>	16.124	(1.985)	-	14.139	(1.642.819)	1.985	-	(1.640.834)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit<sup>2</sup> (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	464.848	(9.663)
<b>Insgesamt</b>	464.848	(9.663)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
JPMorgan Chase Bank	1.170	-	-	1.170	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	4.361	(986)	-	3.375	(986)	986	-	-
State Street Bank and Trust Co	419.717	-	-	419.717	-	-	-	-
UBS AG	5.498	-	-	5.498	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	34.102	(8.677)	-	25.425	(8.677)	8.677	-	-
<b>Insgesamt</b>	464.848	(9.663)	-	455.185	(9.663)	9.663	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	2.069.747	(4.857.533)
<b>Insgesamt</b>	<b>2.069.747</b>	<b>(4.857.533)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
BNP Paribas	356.289	(352.886)	-	3.403	(352.886)	352.886	-	-
Deutsche Bank AG	7.783	(7.783)	-	-	(14.157)	7.783	-	(6.374)
Goldman Sachs International	135.105	(135.105)	-	-	(793.090)	135.105	-	(657.985)
JPMorgan Chase Bank	622	-	-	622	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	47.862	(95)	-	47.767	(95)	95	-	-
Standard Chartered Bank	265.077	(265.077)	-	-	(268.202)	265.077	-	(3.125)
State Street Bank and Trust Co	172.765	(94.768)	-	77.997	(94.768)	94.768	-	-
UBS AG	169.137	(169.137)	-	-	(2.748.144)	169.137	-	(2.579.007)
Westpac Banking Corp	915.107	(586.191)	-	328.916	(586.191)	586.191	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>2.069.747</b>	<b>(1.611.042)</b>	<b>-</b>	<b>458.705</b>	<b>(4.857.533)</b>	<b>1.611.042</b>	<b>-</b>	<b>(3.246.491)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.282.810	(832.806)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.282.810</b>	<b>(832.806)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
BNP Paribas	102.384	(102.384)	-	-	(194.361)	102.384	-	(91.977)
Citibank NA	150.855	(94.809)	-	56.046	(94.809)	94.809	-	-
Deutsche Bank AG	44.522	(36.124)	-	8.398	(36.124)	36.124	-	-
Goldman Sachs International	5.516	(5.516)	-	-	(56.624)	5.516	-	(51.108)
Royal Bank of Canada	1.410	(1.410)	-	-	(24.480)	1.410	-	(23.070)
Standard Chartered Bank	76.501	(76.501)	-	-	(216.408)	76.501	-	(139.907)
State Street Bank and Trust Co	846.387	(125.776)	-	720.611	(125.776)	125.776	-	-
UBS AG	24.859	(24.859)	-	-	(50.780)	24.859	-	(25.921)
Westpac Banking Corp	30.376	(30.376)	-	-	(33.444)	30.376	-	(3.068)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.282.810</b>	<b>(497.755)</b>	<b>-</b>	<b>785.055</b>	<b>(832.806)</b>	<b>497.755</b>	<b>-</b>	<b>(335.051)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	866.015	(147.763)
<b>Insgesamt</b>	<b>866.015</b>	<b>(147.763)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	41.770	(37.969)	-	3.801	(37.969)	37.969	-	-
UBS AG	8.091	(1.801)	-	6.290	(1.801)	1.801	-	-
Westpac Banking Corp	816.154	(107.993)	-	708.161	(107.993)	107.993	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>866.015</b>	<b>(147.763)</b>	<b>-</b>	<b>718.252</b>	<b>(147.763)</b>	<b>147.763</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	13.335	(201.281)
<b>Insgesamt</b>	<b>13.335</b>	<b>(201.281)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	7.101	(7.101)	-	-	(75.382)	7.101	-	(68.281)
UBS AG	917	(917)	-	-	(49.438)	917	-	(48.521)
Westpac Banking Corp	5.317	(5.317)	-	-	(76.461)	5.317	-	(71.144)
<b>Insgesamt</b>	<b>13.335</b>	<b>(13.335)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(201.281)</b>	<b>13.335</b>	<b>-</b>	<b>(187.946)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US\$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US\$
Devisenterminkontrakte	55.707.544	(25.192.706)
OTC-Kontrakt	-	(404.963)
<b>Insgesamt</b>	55.707.544	(25.597.669)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	8.246.368	(1.647.022)	-	6.599.346	(1.647.022)	1.647.022	-	-
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(404.963)	-	300.000	(104.963)
UBS AG	9.516.420	(3.564.399)	-	5.952.021	(3.564.399)	3.564.399	-	-
Westpac Banking Corp	37.944.756	(19.981.285)	-	17.963.471	(19.981.285)	19.981.285	-	-
<b>Insgesamt</b>	55.707.544	(25.192.706)	-	30.514.838	(25.597.669)	25.192.706	300.000	(104.963)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	6.339.440	(25.945.509)
OTC-Kontrakt	658.095	-
Wertpapierleihe	74.575.394	-
<b>Insgesamt</b>	<b>81.572.929</b>	<b>(25.945.509)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Netto- betrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Brown Brothers Harriman	74.575.394	-	-	(74.575.394)	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International	2.099.688	(2.099.688)	-	-	-	(9.010.943)	2.099.688	-	(6.911.255)
JPMorgan Chase Bank	658.095	-	(430.000)	-	228.095	-	-	-	-
UBS AG	1.726.140	(1.726.140)	-	-	-	(7.502.032)	1.726.140	-	(5.775.892)
Westpac Banking Corp	2.513.612	(2.513.612)	-	-	-	(9.432.534)	2.513.612	-	(6.918.922)
<b>Insgesamt</b>	<b>81.572.929</b>	<b>(6.339.440)</b>	<b>(430.000)</b>	<b>(74.575.394)</b>	<b>228.095</b>	<b>(25.945.509)</b>	<b>6.339.440</b>	<b>-</b>	<b>(19.606.069)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup>

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	453.339	(78.732)
<b>Insgesamt</b>	<b>453.339</b>	<b>(78.732)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
JPMorgan Chase Bank	4.236	(4.236)	-	-	(16.573)	4.236	-	(12.337)
Standard Chartered Bank	16.275	(3.158)	-	13.117	(3.158)	3.158	-	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(2.383)	-	-	(2.383)
UBS AG	2.818	(2.818)	-	-	(9.094)	2.818	-	(6.276)
Westpac Banking Corp	430.010	(47.524)	-	382.486	(47.524)	47.524	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>453.339</b>	<b>(57.736)</b>	<b>-</b>	<b>395.603</b>	<b>(78.732)</b>	<b>57.736</b>	<b>-</b>	<b>(20.996)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G<sup>2</sup> (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	40.740	(150.621)
<b>Insgesamt</b>	<b>40.740</b>	<b>(150.621)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	531	(531)	-	-	(11.668)	531	-	(11.137)
JPMorgan Chase Bank	539	-	-	539	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	2.220	-	-	2.220	-	-	-	-
State Street Bank and Trust Co	14.031	(2.238)	-	11.793	(2.238)	2.238	-	-
Westpac Banking Corp	23.419	(23.419)	-	-	(136.715)	23.419	-	(113.296)
<b>Insgesamt</b>	<b>40.740</b>	<b>(26.188)</b>	<b>-</b>	<b>14.552</b>	<b>(150.621)</b>	<b>26.188</b>	<b>-</b>	<b>(124.433)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Japanischen Aktienengagement

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	JPY	JPY
Devisenterminkontrakte	44.531.344	(141.215.249)
<b>Insgesamt</b>	44.531.344	(141.215.249)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten JPY	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY
Standard Chartered Bank	9.748.767	(9.748.767)	-	-	(16.417.996)	9.748.767	-	(6.669.229)
State Street Bank and Trust Co	14.707.131	(14.707.131)	-	-	(52.892.460)	14.707.131	-	(38.185.329)
Westpac Banking Corp	20.075.446	(20.075.446)	-	-	(71.904.793)	20.075.446	-	(51.829.347)
<b>Insgesamt</b>	44.531.344	(44.531.344)	-	-	(141.215.249)	44.531.344	-	(96.683.905)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	JPY	JPY
Devisenterminkontrakte	752.199	(225.405)
<b>Insgesamt</b>	752.199	(225.405)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten JPY	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY	Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY
JPMorgan Chase Bank	43.325	(39.048)	-	4.277	(39.048)	39.048	-	-
Standard Chartered Bank	79.888	(61.097)	-	18.791	(61.097)	61.097	-	-
Westpac Banking Corp	628.986	(125.260)	-	503.726	(125.260)	125.260	-	-
<b>Insgesamt</b>	752.199	(225.405)	-	526.794	(225.405)	225.405	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	3.617.207	(4.428.576)
<b>Insgesamt</b>	<b>3.617.207</b>	<b>(4.428.576)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR
BNP Paribas	1.253.848	(1.224.102)	-	29.746	(1.224.102)	1.224.102	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(702.163)	-	-	(702.163)
Goldman Sachs International	346.789	(346.789)	-	-	(1.143.875)	346.789	-	(797.086)
Standard Chartered Bank	490.351	(391.878)	-	98.473	(391.878)	391.878	-	-
State Street Bank and Trust Co	415.549	(168.777)	-	246.772	(168.777)	168.777	-	-
UBS AG	382.277	(298.409)	-	83.868	(298.409)	298.409	-	-
Westpac Banking Corp	728.393	(499.372)	-	229.021	(499.372)	499.372	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>3.617.207</b>	<b>(2.929.327)</b>	<b>-</b>	<b>687.880</b>	<b>(4.428.576)</b>	<b>2.929.327</b>	<b>-</b>	<b>(1.499.249)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	1.924.532	(2.717.109)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.924.532</b>	<b>(2.717.109)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR
BNP Paribas	243.345	(243.345)	-	-	(675.159)	243.345	-	(431.814)
Citibank NA	553.265	(239.423)	-	313.842	(239.423)	239.423	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(4.433)	-	-	(4.433)
Goldman Sachs International	11.334	(11.334)	-	-	(37.317)	11.334	-	(25.983)
Standard Chartered Bank	132.396	(132.396)	-	-	(1.018.096)	132.396	-	(885.700)
State Street Bank and Trust Co	482.771	(474.621)	-	8.150	(474.621)	474.621	-	-
UBS AG	70.279	(70.279)	-	-	(89.819)	70.279	-	(19.540)
Westpac Banking Corp	431.142	(178.241)	-	252.901	(178.241)	178.241	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.924.532</b>	<b>(1.349.639)</b>	<b>-</b>	<b>574.893</b>	<b>(2.717.109)</b>	<b>1.349.639</b>	<b>-</b>	<b>(1.367.470)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	160.435	(584.335)
<b>Insgesamt</b>	160.435	(584.335)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
BNP Paribas	40.724	(39.912)	-	812	(39.912)	39.912	-	-
Brown Brothers Harriman	11	-	-	11	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(21.485)	-	-	(21.485)
Goldman Sachs International	19.681	(19.681)	-	-	(47.002)	19.681	-	(27.321)
JPMorgan Chase Bank	18	-	-	18	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	68	-	-	68	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	51.221	(10.722)	-	40.499	(10.722)	10.722	-	-
State Street Bank and Trust Co	14.764	(14.764)	-	-	(454.800)	14.764	-	(440.036)
UBS AG	33.175	(10.351)	-	22.824	(10.351)	10.351	-	-
Westpac Banking Corp	773	(63)	-	710	(63)	63	-	-
<b>Insgesamt</b>	160.435	(95.493)	-	64.942	(584.335)	95.493	-	(488.842)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	148.411	(90.067)
OTC-Kontrakt	2.121	-
<b>Insgesamt</b>	150.532	(90.067)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
BNP Paribas	100.957	(24.354)	-	76.603	(24.354)	24.354	-	-
Citibank NA	19.435	(11.479)	-	7.956	(11.479)	11.479	-	-
Deutsche Bank AG	2.750	-	-	2.750	-	-	-	-
Goldman Sachs International	2.459	(2.459)	-	-	(6.134)	2.459	-	(3.675)
Standard Chartered Bank	5.500	(5.500)	-	-	(22.609)	5.500	-	(17.109)
State Street Bank and Trust Co	16.710	(16.036)	-	674	(16.036)	16.036	-	-
UBS AG	2.156	(2.156)	-	-	(3.885)	2.156	-	(1.729)
Westpac Banking Corp	565	(565)	-	-	(5.570)	565	-	(5.005)
<b>Insgesamt</b>	150.532	(62.549)	-	87.983	(90.067)	62.549	-	(27.518)



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	294.328	(213.661)
<b>Insgesamt</b>	<b>294.328</b>	<b>(213.661)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	9.006	(9.006)	-	-	(10.518)	9.006	-	(1.512)
UBS AG	80	(2)	-	78	(2)	2	-	-
Westpac Banking Corp	285.242	(203.141)	-	82.101	(203.141)	203.141	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>294.328</b>	<b>(212.149)</b>	<b>-</b>	<b>82.179</b>	<b>(213.661)</b>	<b>212.149</b>	<b>-</b>	<b>(1.512)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	8.780	(107.390)
<b>Insgesamt</b>	<b>8.780</b>	<b>(107.390)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	-	-	-	-	(26.737)	-	-	(26.737)
Goldman Sachs International	3.422	(3.422)	-	-	(39.718)	3.422	-	(36.296)
UBS AG	1.390	(874)	-	516	(874)	874	-	-
Westpac Banking Corp	3.968	(3.968)	-	-	(40.061)	3.968	-	(36.093)
<b>Insgesamt</b>	<b>8.780</b>	<b>(8.264)</b>	<b>-</b>	<b>516</b>	<b>(107.390)</b>	<b>8.264</b>	<b>-</b>	<b>(99.126)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	46.700.064	(23.986.773)
<b>Insgesamt</b>	<b>46.700.064</b>	<b>(23.986.773)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	-	-	-	-	(5.698.738)	-	-	(5.698.738)
Goldman Sachs International	168.124	(168.124)	-	-	(370.635)	168.124	-	(202.511)
Royal Bank of Canada	210	-	-	210	-	-	-	-
UBS AG	45.553.017	(16.806.182)	-	28.746.835	(16.806.182)	16.806.182	-	-
Westpac Banking Corp	978.713	(978.713)	-	-	(1.111.218)	978.713	-	(132.505)
<b>Insgesamt</b>	<b>46.700.064</b>	<b>(17.953.019)</b>	<b>-</b>	<b>28.747.045</b>	<b>(23.986.773)</b>	<b>17.953.019</b>	<b>-</b>	<b>(6.033.754)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	21.429.031	(17.737.158)
Wertpapierleihe	511.815	-
<b>Insgesamt</b>	<b>21.940.846</b>	<b>(17.737.158)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Brown Brothers Harriman	511.815	-	-	(511.815)	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International	3.144.969	(924.862)	-	-	2.220.107	(924.862)	924.862	-	-
Royal Bank of Canada	7.236.574	(7.236.574)	-	-	-	(7.865.302)	7.236.574	-	(628.728)
UBS AG	3.299.092	(3.299.092)	-	-	-	(8.055.486)	3.299.092	-	(4.756.394)
Westpac Banking Corp	7.748.396	(891.508)	-	-	6.856.888	(891.508)	891.508	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>21.940.846</b>	<b>(12.352.036)</b>	<b>-</b>	<b>(511.815)</b>	<b>9.076.995</b>	<b>(17.737.158)</b>	<b>12.352.036</b>	<b>-</b>	<b>(5.385.122)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	23.012.144	(5.286.451)
<b>Insgesamt</b>	<b>23.012.144</b>	<b>(5.286.451)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	150.807	(31.799)	-	119.008	(31.799)	31.799	-	-
UBS AG	1.077.478	(513.291)	-	564.187	(513.291)	513.291	-	-
Westpac Banking Corp	21.783.859	(4.741.361)	-	17.042.498	(4.741.361)	4.741.361	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>23.012.144</b>	<b>(5.286.451)</b>	<b>-</b>	<b>17.725.693</b>	<b>(5.286.451)</b>	<b>5.286.451</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.240.239	(5.381.257)
Wertpapierleihe	3.553.505	-
<b>Insgesamt</b>	<b>4.793.744</b>	<b>(5.381.257)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Brown Brothers Harriman	3.553.505	-	-	(3.553.505)	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International	397.796	(397.796)	-	-	-	(1.884.525)	397.796	-	(1.486.729)
UBS AG	312.267	(312.267)	-	-	-	(1.477.138)	312.267	-	(1.164.871)
Westpac Banking Corp	530.176	(530.176)	-	-	-	(2.019.594)	530.176	-	(1.489.418)
<b>Insgesamt</b>	<b>4.793.744</b>	<b>(1.240.239)</b>	<b>-</b>	<b>(3.553.505)</b>	<b>-</b>	<b>(5.381.257)</b>	<b>1.240.239</b>	<b>-</b>	<b>(4.141.018)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	29.520.687	(7.161.491)
OTC-Kontrakt	-	(3.863.949)
<b>Insgesamt</b>	29.520.687	(11.025.440)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	19.490	-	-	19.490	-	-	-	-
Citibank NA	120.797	(120.797)	-	-	(539.198)	120.797	-	(418.401)
Goldman Sachs International	911.721	(911.721)	-	-	(7.314.951)	911.721	3.390.000	(3.013.230)
JPMorgan Chase Bank	306.288	(50.895)	-	255.393	(50.895)	50.895	-	-
Morgan Stanley	13.556	-	-	13.556	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	550.752	(550.752)	-	-	(1.936.869)	550.752	-	(1.386.117)
UBS AG	986.309	(624.056)	-	362.253	(624.056)	624.056	-	-
Westpac Banking Corp	26.611.774	(559.471)	-	26.052.303	(559.471)	559.471	-	-
<b>Insgesamt</b>	29.520.687	(2.817.692)	-	26.702.995	(11.025.440)	2.817.692	3.390.000	(4.817.748)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US\$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US\$
Devisenterminkontrakte	2.641.510	(5.071.083)
OTC-Kontrakt	834.436	-
Wertpapierleihe	12.819.976	-
<b>Insgesamt</b>	<b>16.295.922</b>	<b>(5.071.083)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Netto-betrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	187.358	(199)	-	-	187.159	(199)	199	-	-
Brown Brothers Harriman	12.819.976	-	-	(12.819.976)	-	-	-	-	-
Citibank NA	245.470	(50.856)	-	-	194.614	(50.856)	50.856	-	-
Deutsche Bank AG	789	-	-	-	789	-	-	-	-
Goldman Sachs International	1.885.213	(1.727.096)	(158.117)	-	-	(1.727.096)	1.727.096	-	-
HSBC Bank Plc	16.481	(16.481)	-	-	-	(19.935)	16.481	-	(3.454)
JPMorgan Chase Bank	629.298	(224.981)	(340.000)	-	64.317	(224.981)	224.981	-	-
Morgan Stanley	27.574	(3.034)	-	-	24.540	(3.034)	3.034	-	-
Royal Bank of Canada	50.250	(50.250)	-	-	-	(105.565)	50.250	-	(55.315)
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	(4.287)	-	-	(4.287)
UBS AG	93.572	(93.572)	-	-	-	(1.274.506)	93.572	-	(1.180.934)
Westpac Banking Corp	339.941	(339.941)	-	-	-	(1.660.624)	339.941	-	(1.320.683)
<b>Insgesamt</b>	<b>16.295.922</b>	<b>(2.506.410)</b>	<b>(498.117)</b>	<b>(12.819.976)</b>	<b>471.419</b>	<b>(5.071.083)</b>	<b>2.506.410</b>	<b>-</b>	<b>(2.564.673)</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	282.337	(29.229)
<b>Insgesamt</b>	<b>282.337</b>	<b>(29.229)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	4.110	(4.110)	-	-	(11.267)	4.110	-	(7.157)
Standard Chartered Bank	664	(191)	-	473	(191)	191	-	-
State Street Bank and Trust Co	7.594	-	-	7.594	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	269.969	(17.771)	-	252.198	(17.771)	17.771	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>282.337</b>	<b>(22.072)</b>	<b>-</b>	<b>260.265</b>	<b>(29.229)</b>	<b>22.072</b>	<b>-</b>	<b>(7.157)</b>

31. Dezember 2021

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	853.222	(134.345)
<b>Insgesamt</b>	<b>853.222</b>	<b>(134.345)</b>

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	8.040	(1.385)	-	6.655	(1.385)	1.385	-	-
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(713)	-	-	(713)
UBS AG	-	-	-	-	(3.614)	-	-	(3.614)
Westpac Banking Corp	845.182	(128.633)	-	716.549	(128.633)	128.633	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>853.222</b>	<b>(130.018)</b>	<b>-</b>	<b>723.204</b>	<b>(134.345)</b>	<b>130.018</b>	<b>-</b>	<b>(4.327)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	501.625	(45.258)
<b>Insgesamt</b>	501.625	(45.258)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	189.787	(30.627)	-	159.160	(30.627)	30.627	-	-
JPMorgan Chase Bank	2.035	(2.035)	-	-	(3.202)	2.035	-	(1.167)
UBS AG	302.323	(2.344)	-	299.979	(2.344)	2.344	-	-
Westpac Banking Corp	7.480	(7.480)	-	-	(9.085)	7.480	-	(1.605)
<b>Insgesamt</b>	501.625	(42.486)	-	459.139	(45.258)	42.486	-	(2.772)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency<sup>1</sup>

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.237.337	(862.058)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.237.337</b>	<b>(862.058)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(18.613)	-	-	(18.613)
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	(832.685)	-	-	(832.685)
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(3.534)	-	-	(3.534)
Westpac Banking Corp	1.237.337	(7.226)	-	1.230.111	(7.226)	7.226	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.237.337</b>	<b>(7.226)</b>	<b>-</b>	<b>1.230.111</b>	<b>(862.058)</b>	<b>7.226</b>	<b>-</b>	<b>(854.832)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Systematic Global Sustainable Value

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	125.312	(90.456)
<b>Insgesamt</b>	<b>125.312</b>	<b>(90.456)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	1.555	(1.312)	-	243	(1.312)	1.312	-	-
UBS AG	316	-	-	316	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	123.441	(89.144)	-	34.297	(89.144)	89.144	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>125.312</b>	<b>(90.456)</b>	<b>-</b>	<b>34.856</b>	<b>(90.456)</b>	<b>90.456</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Systematic Global Sustainable Value (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	29.635	(40.232)
<b>Insgesamt</b>	<b>29.635</b>	<b>(40.232)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	7.892	(7.892)	-	-	(14.580)	7.892	-	(6.688)
UBS AG	6.306	(6.306)	-	-	(11.296)	6.306	-	(4.990)
Westpac Banking Corp	15.437	(14.356)	-	1.081	(14.356)	14.356	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>29.635</b>	<b>(28.554)</b>	<b>-</b>	<b>1.081</b>	<b>(40.232)</b>	<b>28.554</b>	<b>-</b>	<b>(11.678)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	232.108	(6.570.781)
<b>Insgesamt</b>	232.108	(6.570.781)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto- beträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR
Goldman Sachs International	3.596	(3.596)	-	-	(44.332)	3.596	-	(40.736)
Westpac Banking Corp	228.512	(228.512)	-	-	(6.526.449)	228.512	-	(6.297.937)
<b>Insgesamt</b>	232.108	(232.108)	-	-	(6.570.781)	232.108	-	(6.338.673)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	EUR	EUR
Devisenterminkontrakte	1.198.442	(228.659)
Wertpapierleihe	10.227.006	-
<b>Insgesamt</b>	<b>11.425.448</b>	<b>(228.659)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR	Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR
Brown Brothers Harriman	10.227.006	-	-	(10.227.006)	-	-	-	-	-
Citibank NA	339.261	-	-	-	339.261	-	-	-	-
Goldman Sachs International	418.883	(65.644)	-	-	353.239	(65.644)	65.644	-	-
Westpac Banking Corp	440.298	(163.015)	-	-	277.283	(163.015)	163.015	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>11.425.448</b>	<b>(228.659)</b>	<b>-</b>	<b>(10.227.006)</b>	<b>969.783</b>	<b>(228.659)</b>	<b>228.659</b>	<b>-</b>	<b>-</b>



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	212.294.005	(37.812.332)
OTC-Kontrakt	135.115.207	(73.650.446)
OTC-Optionen	131.345.140	(284.967.910)
OTC Swaptions	1.388.392	(708.024)
<b>Insgesamt</b>	<b>480.142.744</b>	<b>(397.138.712)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Barclays Bank Plc	131	-	-	131	-	-	-	
Bank of America Merrill Lynch	25.332.023	(12.164.030)	-	13.167.993	(12.164.030)	12.164.030	-	
BNP Paribas	25.173.420	(770.244)	(5.000)	24.398.176	(770.244)	770.244	-	
Citibank NA	969.403	(127.806)	(110.000)	731.597	(127.806)	127.806	-	
Daiwa	21.787	-	-	21.787	-	-	-	
Deutsche Bank AG	263.885	(263.885)	-	-	(274.819)	263.885	(10.934)	
Goldman Sachs International	65.259.726	(48.888.862)	-	16.370.864	(48.888.862)	48.888.862	-	
JPMorgan Chase Bank	131.590.229	(131.590.229)	-	-	(294.012.216)	131.590.229	162.421.987	
Morgan Stanley	24.129.157	(24.129.157)	-	-	(27.235.440)	24.129.157	3.106.283	

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge (Fortsetzung):

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Nomura International	7.243.522	(130.072)		7.113.450	(130.072)	130.072	-	-
Royal Bank of Canada	65.198	(3.929)	-	61.269	(3.929)	3.929	-	-
Royal Bank of Scotland	385.989	(103.346)	-	282.643	(103.346)	103.346	-	-
SMBC Nikko Capital Markets Ltd	1.202.717	-	-	1.202.717	-	-	-	-
Société Générale	10.320.647	(2.854.549)	-	7.466.098	(2.854.549)	2.854.549	-	-
State Street Bank and Trust Co	140.078.733	(2.627.400)	-	137.451.333	(2.627.400)	2.627.400	-	-
UBS AG	23.625.469	(2.801.808)	-	20.823.661	(2.801.808)	2.801.808	-	-
Westpac Banking Corp	24.480.708	(5.144.191)	-	19.336.517	(5.144.191)	5.144.191	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>480.142.744</b>	<b>(231.599.508)</b>	<b>(115.000)</b>	<b>248.428.236</b>	<b>(397.138.712)</b>	<b>231.599.508</b>	<b>165.528.270</b>	<b>(10.934)</b>

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US\$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US\$
Devisenterminkontrakte	23.765.615	(40.945.220)
OTC-Kontrakt	141.599.519	(113.311.497)
OTC-Optionen	3.305.075	-
OTC Swaptions	343.188	-
<b>Insgesamt</b>	<b>169.013.397</b>	<b>(154.256.717)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

31. Dezember 2021 (Fortsetzung)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Bank of America Merrill Lynch	329.643	(329.643)	-	-	(1.060.923)	329.643	-	(731.280)
Barclays Bank Plc	387.305	(387.305)	-	-	(2.020.953)	387.305	-	(1.633.648)
BNP Paribas	4.710.549	(4.710.549)	-	-	(5.478.859)	4.710.549	-	(768.310)
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	(45.646)	-	-	(45.646)
Citibank NA	1.607.422	(1.607.422)	-	-	(2.370.003)	1.607.422	-	(762.581)
Deutsche Bank AG	1.026.468	(1.026.468)	-	-	(1.521.798)	1.026.468	-	(495.330)
Goldman Sachs International	59.977.133	(45.243.746)	-	14.733.387	(45.243.746)	45.243.746	-	-
JPMorgan Chase Bank	39.014.173	(32.183.664)	-	6.830.509	(32.183.664)	32.183.664	-	-
Morgan Stanley	43.585.006	(31.297.942)	(690.000)	11.597.064	(31.297.942)	31.297.942	-	-
Royal Bank of Scotland	444.291	(35.590)	-	408.701	(35.590)	35.590	-	-
Société Générale	9.003.786	(9.003.786)	-	-	(16.118.568)	9.003.786	7.114.782	-
State Street Bank and Trust Co	1.287.000	(1.287.000)	-	-	(1.672.735)	1.287.000	-	(385.735)
UBS AG	3.071.933	(3.071.933)	-	-	(8.008.827)	3.071.933	2.560.000	(2.376.894)
Westpac Banking Corp	4.568.688	(4.568.688)	-	-	(7.197.463)	4.568.688	-	(2.628.775)
<b>Insgesamt</b>	<b>169.013.397</b>	<b>(134.753.736)</b>	<b>(690.000)</b>	<b>33.569.661</b>	<b>(154.256.717)</b>	<b>134.753.736</b>	<b>9.674.782</b>	<b>(9.828.199)</b>

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

XXXXXXXXXX<sup>1</sup>

## 31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	54.485.356	(6.317.151)
OTC-Kontrakt	17.299.613	(5.597.643)
OTC-Optionen	20.845.166	(36.846.895)
OTC Swaptions	68.848	(20.738)
<b>Insgesamt</b>	<b>92.698.983</b>	<b>(48.782.427)</b>

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Bank of America Merrill Lynch	6.835.857	(6.835.857)	-	-	(7.154.155)	6.835.857	318.298	-
BNP Paribas	710.195	(477.433)	-	232.762	(477.433)	477.433	-	-
Daiwa	334.964	-	-	334.964	-	-	-	-
Goldman Sachs International	3.131.104	(3.131.104)	-	-	(4.054.674)	3.131.104	-	(923.570)
JPMorgan Chase Bank	14.193.789	(14.193.789)	-	-	(34.580.892)	14.193.789	20.387.103	-
Morgan Stanley	222.140	(222.140)	-	-	(227.302)	222.140	-	(5.162)
Nomura International	2.318.816	(42.011)	-	2.276.805	(42.011)	42.011	-	-
SMBC Nikko Capital Markets Ltd	1.907.956	-	-	1.907.956	-	-	-	-
Société Générale	8.370.879	(1.230.904)	-	7.139.975	(1.230.904)	1.230.904	-	-
State Street Bank and Trust Co	49.433.338	-	-	49.433.338	-	-	-	-
UBS AG	4.886.978	(509.845)	-	4.377.133	(509.845)	509.845	-	-
Westpac Banking Corp	352.967	(352.967)	-	-	(505.211)	352.967	-	(152.244)
<b>Insgesamt</b>	<b>92.698.983</b>	<b>(26.996.050)</b>	<b>-</b>	<b>65.702.933</b>	<b>(48.782.427)</b>	<b>26.996.050</b>	<b>20.705.401</b>	<b>(1.080.976)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	2.158.080	(546.931)
<b>Insgesamt</b>	<b>2.158.080</b>	<b>(546.931)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Royal Bank of Canada	70.555	(70.555)	-	-	(140.295)	70.555	-	(69.740)
UBS AG	98.971	(35.034)	-	63.937	(35.034)	35.034	-	-
Westpac Banking Corp	1.988.554	(371.602)	-	1.616.952	(371.602)	371.602	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>2.158.080</b>	<b>(477.191)</b>	<b>-</b>	<b>1.680.889</b>	<b>(546.931)</b>	<b>477.191</b>	<b>-</b>	<b>(69.740)</b>

31. Dezember 2021

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	16.592.327	(1.350.871)
<b>Insgesamt</b>	16.592.327	(1.350.871)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	177.418	(177.418)	-	-	(408.941)	177.418	-	(231.523)
Westpac Banking Corp	16.414.909	(941.930)	-	15.472.979	(941.930)	941.930	-	-
<b>Insgesamt</b>	16.592.327	(1.119.348)	-	15.472.979	(1.350.871)	1.119.348	-	(231.523)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	1.075.693	(155.752)
<b>Insgesamt</b>	<b>1.075.693</b>	<b>(155.752)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Citibank NA	18.866	(18.866)	-	-	(37.799)	18.866	-	(18.933)
Goldman Sachs International	25.240	(25.240)	-	-	(49.306)	25.240	-	(24.066)
Westpac Banking Corp	1.031.587	(68.647)	-	962.940	(68.647)	68.647	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>1.075.693</b>	<b>(112.753)</b>	<b>-</b>	<b>962.940</b>	<b>(155.752)</b>	<b>112.753</b>	<b>-</b>	<b>(42.999)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value<sup>2</sup>

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	973.737	(102.612)
<b>Insgesamt</b>	<b>973.737</b>	<b>(102.612)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Netto- betrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	
JPMorgan Chase Bank	276.563	(8.511)	-	-	268.052	(8.511)	8.511	-	-	
Standard Chartered Bank	253.879	(10.265)	-	-	243.614	(10.265)	10.265	-	-	
Westpac Banking Corp	443.295	(83.836)	-	-	359.459	(83.836)	83.836	-	-	
<b>Insgesamt</b>	<b>973.737</b>	<b>(102.612)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>871.125</b>	<b>(102.612)</b>	<b>102.612</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	

31. Dezember 2021

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.



FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	6.686.844	(822.791)
OTC-Kontrakt	3.827.134	(1.992.712)
<b>Insgesamt</b>	<b>10.513.978</b>	<b>(2.815.503)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten				
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Netto- betrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	
Goldman Sachs International	3.014.864	(1.622.276)	-	-	1.392.588	(1.622.276)	1.622.276	-	-	
JPMorgan Chase Bank	871.513	(372.750)	-	-	498.763	(372.750)	372.750	-	-	
UBS AG	35.400	(35.400)	-	-	-	(76.976)	35.400	-	(41.576)	
Westpac Banking Corp	6.592.201	(743.501)	-	-	5.848.700	(743.501)	743.501	-	-	
<b>Insgesamt</b>	<b>10.513.978</b>	<b>(2.773.927)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>7.740.051</b>	<b>(2.815.503)</b>	<b>2.773.927</b>	<b>-</b>	<b>(41.576)</b>	

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	304.263	(4.166.530)
OTC-Kontrakt	2.460.212	(16.020.371)
Wertpapierleihe	6.672.007	-
<b>Insgesamt</b>	<b>9.436.482</b>	<b>(20.186.901)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte					Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich- keiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere, Zeitwert <sup>(a)</sup> US\$	Netto- betrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Brown Brothers Harriman	6.672.007	-	-	(6.672.007)	-	-	-	-	-
Citibank NA	23.705	(23.705)	-	-	-	(1.137.082)	23.705	-	(1.113.377)
Goldman Sachs International	1.868.009	(1.868.009)	-	-	-	(4.990.426)	1.868.009	1.720.000	(1.402.417)
JPMorgan Chase Bank	629.554	(629.554)	-	-	-	(12.556.037)	629.554	11.926.483	-
UBS AG	4.638	(4.638)	-	-	-	(6.905)	4.638	-	(2.267)
Westpac Banking Corp	238.569	(238.569)	-	-	-	(1.496.451)	238.569	-	(1.257.882)
<b>Insgesamt</b>	<b>9.436.482</b>	<b>(2.764.475)</b>	<b>-</b>	<b>(6.672.007)</b>	<b>-</b>	<b>(20.186.901)</b>	<b>2.764.475</b>	<b>13.646.483</b>	<b>(3.775.943)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	2.736.142	(587.402)
<b>Insgesamt</b>	<b>2.736.142</b>	<b>(587.402)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	678.594	(86.777)	-	591.817	(86.777)	86.777	-	-
UBS AG	103.906	(68.135)	-	35.771	(68.135)	68.135	-	-
Westpac Banking Corp	1.953.642	(432.490)	-	1.521.152	(432.490)	432.490	-	-
<b>Insgesamt</b>	<b>2.736.142</b>	<b>(587.402)</b>	<b>-</b>	<b>2.148.740</b>	<b>(587.402)</b>	<b>587.402</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	427.087	(1.041.858)
<b>Insgesamt</b>	<b>427.087</b>	<b>(1.041.858)</b>

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	79.827	(79.827)	-	-	(329.143)	79.827	-	(249.316)
UBS AG	73.849	(73.849)	-	-	(297.321)	73.849	-	(223.472)
Westpac Banking Corp	273.411	(273.411)	-	-	(415.394)	273.411	-	(141.983)
<b>Insgesamt</b>	<b>427.087</b>	<b>(427.087)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1.041.858)</b>	<b>427.087</b>	<b>-</b>	<b>(614.771)</b>

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	4.089.640	(1.230.032)
<b>Insgesamt</b>	4.089.640	(1.230.032)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	1.575.053	(296.037)	-	1.279.016	(296.037)	296.037	-	-
UBS AG	112.854	(41.658)	-	71.196	(41.658)	41.658	-	-
Westpac Banking Corp	2.401.733	(892.337)	-	1.509.396	(892.337)	892.337	-	-
<b>Insgesamt</b>	4.089.640	(1.230.032)	-	2.859.608	(1.230.032)	1.230.032	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	789.444	(3.778.536)
<b>Insgesamt</b>	789.444	(3.778.536)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	211.217	(211.217)	-	-	(1.201.262)	211.217	-	(990.045)
UBS AG	54.336	(54.336)	-	-	(964.262)	54.336	-	(909.926)
Westpac Banking Corp	523.891	(523.891)	-	-	(1.613.012)	523.891	-	(1.089.121)
<b>Insgesamt</b>	789.444	(789.444)	-	-	(3.778.536)	789.444	-	(2.989.092)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	949.457	(236.699)
<b>Insgesamt</b>	949.457	(236.699)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	186.760	(54.952)	-	131.808	(54.952)	54.952	-	-
UBS AG	17.959	(7.319)	-	10.640	(7.319)	7.319	-	-
Westpac Banking Corp	744.738	(174.428)	-	570.310	(174.428)	174.428	-	-
<b>Insgesamt</b>	949.457	(236.699)	-	712.758	(236.699)	236.699	-	-

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 27. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2021

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten
	US\$	US\$
Devisenterminkontrakte	191.707	(653.133)
<b>Insgesamt</b>	<b>191.707</b>	<b>(653.133)</b>

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Gegenpartei	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$	Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$	In der Aufstellung der Vermögens- werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$	Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$	Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$
Goldman Sachs International	29.542	(29.542)	-	-	(213.330)	29.542	-	(183.788)
UBS AG	5.676	(5.676)	-	-	(170.715)	5.676	-	(165.039)
Westpac Banking Corp	156.489	(156.489)	-	-	(269.088)	156.489	-	(112.599)
<b>Insgesamt</b>	<b>191.707</b>	<b>(191.707)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(653.133)</b>	<b>191.707</b>	<b>-</b>	<b>(461.426)</b>

(a) Die erhaltenen (oder verpfändeten) Sicherheiten sind auf einen Betrag begrenzt, der 100 % des Nettobetrags der Vermögenswerte (oder Verbindlichkeiten) in den oben dargestellten Tabellen für die jeweilige Gegenpartei nicht überschreiten darf.

(b) Ein Nettobetrag größer als null entspricht den Beträgen, die bei einem Ausfall einer Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 einem Verlust unterliegen. Ein Nettobetrag kleiner als null entspricht für jede Gegenpartei unterbesicherte Beträge zum 31. Dezember 2022.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.



**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2022 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**28. GESCHLOSSENE FONDS**

Neben den in diesem Bericht aufgeführten Fonds gibt es eine Reihe geschlossener Teilfonds, deren Zulassung noch nicht zurückgenommen wurde. Eine vollständige Liste dieser Fonds ist nachstehend angegeben. Am Ende des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022 hielt einer dieser Teilfonds, der Lehman Brothers Commodity Plus Fund, einen Betrag in Höhe von 1,84 Mio. US\$ (31. Dezember 2021: 1,82 Mio. US\$) auf einem Konto bei der Verwahrstelle in Zusammenhang mit einem noch nicht beigelegten Rechtsstreit hinsichtlich einer Derivate-Transaktion.

- Lehman Brothers Global Value Fund
- Lehman Brothers USA Value Fund
- Lehman Brothers European Value Fund
- Lehman Brothers Global Bond Fund
- Lehman Brothers US Bond Fund
- Lehman Brothers Emerging Markets Local Currency Bond Fund
- Lehman Brothers US Large Cap Value Fund
- Lehman Brothers Socially Responsible Investment Fund
- Lehman Brothers Commodity Plus Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 2 Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 4 Fund
- Lehman Brothers Global Real Estate Securities Fund

# Anhang I

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT)

Für das zum 31. Dezember 2022 endende Geschäftsjahr basieren die Gesamtkostenquoten („TERs“) auf die den angegebenen Daten vorangegangenen zwölf Monate.

### 31. Dezember 2022

#### 5G Connectivity

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse AUD A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse CNY A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,96 %	0,96 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,96 %	0,96 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,53 %	0,53 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,61 %	2,61 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,96 %	0,96 %
Thesaurierende Klasse HKD A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,96 %	0,96 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,96 %	0,96 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,53 %	0,53 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,61 %	2,61 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,11 %	0,11 %

#### Asian Debt - Hard Currency

Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	2,42 %	1,37 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,43 %	1,37 %
Thesaurierende Klasse USD C1	3,43 %	2,37 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,83 %	0,77 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,65 %	0,77 %
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	1,13 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse USD I4	1,13 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,02 %	1,97 %
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	1,87 %	1,25 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,94 %	0,99 %
Thesaurierende Klasse USD Z	2,34 %	0,15 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### China A-Share Equity

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse CNY I	5,55 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	4,57 %	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	5,55 %	1,20 %

##### China Bond

Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,57 %	1,50 %
Ausschüttende Klasse CNY I	0,97 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse CNY Z	0,27 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,81 %	0,72 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	1,61 %	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,96 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,27 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	0,27 %	0,20 %

##### China Equity

Thesaurierende Klasse CHF I	1,22 %	1,22 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,97 %	1,97 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,22 %	1,22 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,10 %	0,10 %
Ausschüttende Klasse GBP A	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,97 %	1,97 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,97 %	1,97 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,97 %	1,97 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,22 %	1,22 %
Thesaurierende Klasse USD I2	1,00 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,57 %	1,57 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,12 %	0,12 %

##### CLO Income

Thesaurierende Klasse EUR A	1,55 %	1,55 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,83 %	0,83 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,70 %	0,70 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### CLO Income (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,11 %	0,11 %
Thesaurierende Klasse SEK I	0,85 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,55 %	1,55 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,69 %	0,69 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,09 %	0,09 %

##### Commodities

Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	1,51 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,63 %	0,53 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,32 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,63 %	0,53 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,30 %	2,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,31 %	0,20 %

##### Corporate Hybrid Bond

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,64 %	0,64 %
Ausschüttende Klasse CHF P	0,64 %	0,64 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,67 %	0,67 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,67 %	0,67 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,55 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,49 %	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,37 %	0,37 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,87 %	1,87 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,87 %	1,87 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse EUR P	0,64 %	0,64 %
Ausschüttende Klasse EUR P	0,64 %	0,64 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,67 %	0,67 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,55 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,64 %	0,64 %
Ausschüttende Klasse GBP P	0,64 %	0,64 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,27 %	1,27 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,27 %	1,27 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,27 %	2,27 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,67 %	0,67 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,67 %	0,67 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,55 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,87 %	1,87 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,87 %	1,87 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,64 %	0,64 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,07 %	0,07 %

##### Emerging Market Debt - Hard Currency

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Ausschüttende Klasse AUD I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,75 %	0,75 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,78 %	0,78 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,65 %	0,65 %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,51 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,43 %	0,43 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,29 %	2,29 %
Ausschüttende Klasse EUR M	2,28 %	2,28 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,75 %	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,09 %	0,09 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,75 %	0,75 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,48 %	1,48 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse SEK I2	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,49 %	1,49 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,48 %	1,48 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,49 %	2,49 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,29 %	2,29 %
Ausschüttende Klasse USD M	2,29 %	2,29 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,75 %	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,09 %	0,09 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### Emerging Market Debt - Local Currency

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse AUD B	2,96 %	2,96 %
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	2,96 %	2,96 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,96 %	2,96 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,95 %	1,95 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,95 %	1,95 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,68 %	1,68 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,91 %	0,91 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)	0,51 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,62 %	0,62 %
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,52 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,66 %	1,66 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,66 %	1,66 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,66 %	1,66 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,65 %	1,65 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,97 %	2,97 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	2,96 %	2,96 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,96 %	2,96 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	2,96 %	2,96 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,96 %	2,96 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,91 %	0,91 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,93 %	0,93 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,76 %	0,76 %
Thesaurierende Klasse USD I5	– %	– %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,95 %	1,95 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,95 %	1,95 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,53 %	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD Y	0,51 %	0,51 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	2,97 %	2,97 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	2,98 %	2,98 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,98 %	2,98 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,95 %	1,95 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,95 %	1,95 %

## Emerging Market Debt Blend

Ausschüttende Klasse AUD I3	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,56 %	1,56 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,86 %	0,86 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,86 %	0,86 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,73 %	0,73 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,73 %	0,73 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,51 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,36 %	2,36 %
Ausschüttende Klasse EUR M	2,36 %	2,36 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,16 %	0,16 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,86 %	0,86 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,86 %	0,86 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,84 %	0,84 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,83 %	0,83 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,16 %	0,16 %



## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse NOK U	1,21 %	1,21 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,56 %	1,56 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,56 %	1,56 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,56 %	1,56 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,56 %	1,56 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,56 %	2,56 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,72 %	0,72 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,36 %	2,36 %
Ausschüttende Klasse USD M	2,36 %	2,36 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,16 %	0,16 %

##### Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Thesaurierende Klasse AUD I2	1,10 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse NOK I	1,22 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,21 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I2	1,10 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,63 %	0,20 %

##### Emerging Markets Equity

Thesaurierende Klasse AUD B	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse AUD E	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse AUD T	2,26 %	2,26 %
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	1,26 %	1,26 %
Ausschüttende Klasse CAD I2	1,06 %	1,06 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,26 %	1,26 %
Thesaurierende Klasse EUR M	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,26 %	0,26 %
Thesaurierende Klasse GBP I	1,26 %	1,26 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,26 %	0,26 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,26 %	2,26 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD B	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse USD C2	3,27 %	3,27 %
Thesaurierende Klasse USD E	3,27 %	3,27 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,26 %	1,26 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse USD T	2,27 %	2,27 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,26 %	0,26 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	3,26 %	3,26 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	2,26 %	2,26 %

##### Emerging Markets Select Equity

Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	1,13 %	1,13 %
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	1,13 %	1,13 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,13 %	1,13 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,69 %	0,69 %

##### Euro Bond Absolute Return

Thesaurierende Klasse EUR I	0,79 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,79 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,57 %	0,43 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,34 %	0,20 %

##### Euro Opportunistic Bond

Thesaurierende Klasse EUR I	1,62 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse EUR I	1,52 %	0,55 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### European High Yield Bond

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse EUR I	1,18 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,38 %	2,00 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,78 %	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,79 %	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,18 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,78 %	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,58 %	0,20 %

##### European Sustainable Equity

Ausschüttende Klasse EUR A	1,64 %	1,64 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,74 %	0,74 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,73 %	0,73 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,56 %	0,56 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,44 %	0,44 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,44 %	2,44 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,31 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	1,61 %	1,61 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,74 %	0,74 %
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	2,41 %	2,41 %

##### Event Driven

Thesaurierende Klasse GBP I5	0,96 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I5	0,96 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP P	1,41 %	1,15 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,46 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,96 %	0,70 %

##### Global Bond

Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,08 %	1,08 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,83 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,51 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,41 %	1,39 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,09 %	1,08 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,21 %	0,20 %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## Global Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,08 %	1,08 %

## Global Diversified Income FMP – 2024

Thesaurierende Klasse EUR A	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse EUR A	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse HKD A	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse SGD A	0,87 %	0,87 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,87 %	0,87 %
Ausschüttende Klasse USD A	0,87 %	0,87 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,52 %	0,52 %
Ausschüttende Klasse USD X	0,52 %	0,52 %

## Global Equity Megatrends

Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,76 %	2,76 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,96 %	1,96 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,96 %	2,96 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,76 %	2,76 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,23 %	0,23 %

## Global Flexible Credit Income

Thesaurierende Klasse CAD I5	0,38 %	0,38 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,08 %	2,08 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,38 %	0,38 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,28 %	1,28 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,68 %	0,68 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,08 %	2,08 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,08 %	0,08 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

#### Global High Yield SDG Engagement

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse AUD I	0,81 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,53 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse CHF I4	0,54 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse CHF X	1,31 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,53 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse EUR I4	0,54 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse EUR X	1,32 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	0,47 %	0,23 %
Thesaurierende Klasse GBP I4	0,53 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse GBP X	1,32 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,58 %	1,33 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,99 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,54 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse USD M	2,20 %	1,93 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,25 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,37 %	0,13 %

#### Global High Yield Sustainable Action

Thesaurierende Klasse USD I	1,51 %	0,80 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,50 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,10 %	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD Y	1,07 %	0,38 %

#### Global Investment Grade Credit

Thesaurierende Klasse USD I	0,67 %	0,45 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,35 %	0,25 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,22 %	0,15 %

#### Global Opportunistic Bond

Thesaurierende Klasse EUR I	0,72 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,70 %	0,54 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

#### Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD A	1,07 %	0,91 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,73 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,72 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,65 %	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,37 %	0,20 %

#### Global Real Estate Securities

Ausschüttende Klasse EUR I5	0,87 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR M	3,00 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,50 %	0,30 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,50 %	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,99 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD CI	3,00 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,24 %	1,05 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,87 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,99 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,49 %	0,30 %

#### Global Sustainable Equity

Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,42 %	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,42 %	2,42 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,12 %	0,12 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,73 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,43 %	0,43 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,63 %	1,63 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,72 %	0,72 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,41 %	2,41 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,19 %	0,19 %

#### High Yield Bond

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse AUD A	1,30 %	1,30 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

#### High Yield Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse AUD B	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,91 %	2,91 %
Ausschüttende Klasse AUD I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,90 %	1,90 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	1,90 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,89 %	1,89 %
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,60 %	0,60 %
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,60 %	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,89 %	1,89 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,10 %	0,10 %
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse GBP A	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,60 %	0,60 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,10 %	0,10 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse SEK A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse USD C	1,90 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,30 %	2,30 %
Ausschüttende Klasse USD C1	2,30 %	2,30 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,60 %	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,59 %	0,59 %
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	0,46 %	0,46 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,90 %	1,90 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,90 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,67 %	0,67 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,90 %	1,90 %
Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	1,90 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,90 %	1,90 %
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	1,00 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,00 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,10 %	0,10 %



## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

#### High Yield Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,90 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,90 %	1,90 %

#### InnovAsia 5G

Thesaurierende Klasse CHF I4	1,90 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse EUR A	3,12 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	1,95 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	4,09 %	2,70 %
Thesaurierende Klasse EUR X	2,89 %	1,65 %
Thesaurierende Klasse SGD A	3,15 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse SGD I4	1,97 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse SGD X	2,88 %	1,65 %
Thesaurierende Klasse USD A	3,14 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD I	2,21 %	1,05 %
Thesaurierende Klasse USD I4	1,90 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,95 %	2,70 %
Thesaurierende Klasse USD X	2,86 %	1,65 %

#### Japan Equity Engagement

Ausschüttende Klasse EUR I5	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,96 %	0,96 %
Thesaurierende Klasse JPY I	1,00 %	1,00 %
Ausschüttende Klasse JPY I	1,00 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse JPY I5	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse JPY Z	0,19 %	0,19 %

#### Macro Opportunities FX

Thesaurierende Klasse EUR I	1,12 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,52 %	0,20 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

#### Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse SEK I	1,11 %	0,80 %
Ausschüttende Klasse SEK I	1,12 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,11 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,51 %	0,20 %

#### Multi-Asset Income

Ausschüttende Klasse GBP P	2,15 %	0,82 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,83 %	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD C1	3,82 %	2,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	2,18 %	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD I	2,13 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,60 %	2,30 %

#### Next Generation Mobility

Thesaurierende Klasse EUR A	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,02 %	1,02 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	1,03 %	1,03 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,68 %	2,68 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,88 %	2,88 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,02 %	1,02 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,03 %	1,03 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,68 %	2,68 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,73 %	1,73 %

#### Next Generation Space Economy

Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	2,85 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	4,82 %	2,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	3,18 %	1,05 %

#### Short Duration Emerging Market Debt

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,07 %	1,07 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse CHF A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse CHF A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse CHF I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse CHF I2	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse CHF I5	0,32 %	0,32 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,32 %	0,32 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,67 %	1,67 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,67 %	1,67 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse EUR U	0,82 %	0,82 %
Ausschüttende Klasse EUR X	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse GBP I5	0,32 %	0,32 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,07 %	1,07 %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,07 %	2,07 %
Ausschüttende Klasse USD C1	2,07 %	2,07 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,32 %	0,32 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,32 %	0,32 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,67 %	1,67 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,67 %	1,67 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,07 %	0,07 %

## Short Duration High Yield SDG Engagement

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,90 %	1,90 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,90 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,60 %	0,60 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,28 %	1,28 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,68 %	0,68 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,30 %	2,30 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,60 %	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,38 %	0,38 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,90 %	1,90 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,90 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,10 %	0,10 %

##### Strategic Income

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	0,11 %	0,11 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,17 %	1,17 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,71 %	1,71 %
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse JPY I CG	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse JPY Z	0,11 %	0,11 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,11 %	1,11 %
Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,11 %	1,11 %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## Strategic Income (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse USD A	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,11 %	2,11 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,71 %	1,71 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,71 %	1,71 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,11 %	0,11 %

## Sustainable Asia High Yield

Thesaurierende Klasse EUR X	0,76 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse GBP X	1,18 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,84 %	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,86 %	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,21 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,78 %	0,20 %
Ausschüttende Klasse USD Z	0,71 %	0,20 %

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Thesaurierende Klasse CHF I	1,11 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,79 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,93 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,12 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,79 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,71 %	2,60 %
Ausschüttende Klasse EUR M	2,71 %	2,60 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,78 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse GBP I	1,11 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,91 %	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,90 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,91 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,91 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,11 %	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,11 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,95 %	0,84 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

#### Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD I5	0,71 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,71 %	2,60 %
Ausschüttende Klasse USD M	2,72 %	2,60 %

#### Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency

Thesaurierende Klasse EUR I3	0,62 %	0,62 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,55 %	0,45 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,89 %	0,89 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,53 %	0,53 %

#### Systematic Global Sustainable Value

Thesaurierende Klasse EUR M	2,36 %	2,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	1,17 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,91 %	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I3	1,05 %	0,62 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,62 %	0,30 %

#### Ultra Short Term Euro Bond

Thesaurierende Klasse CHF P	0,26 %	0,26 %
Thesaurierende Klasse CHF U	0,37 %	0,37 %
Thesaurierende Klasse EUR A	0,45 %	0,45 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,26 %	0,26 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,27 %	0,27 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,22 %	0,22 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,16 %	0,16 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,05 %	1,05 %
Thesaurierende Klasse EUR U	0,36 %	0,36 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,07 %	0,07 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,26 %	0,26 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,08 %	0,08 %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse CHF I	0,91 %	0,91 %
Thesaurierende Klasse CHF I5	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,66 %	1,66 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,91 %	0,91 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,76 %	0,76 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,47 %	2,47 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,91 %	0,91 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,80 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,88 %	0,88 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,16 %	0,16 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,93 %	0,93 %
Thesaurierende Klasse SDG A	1,66 %	1,66 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,67 %	1,67 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,66 %	2,66 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,92 %	0,92 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,76 %	0,76 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,47 %	2,47 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,88 %	0,88 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,17 %	0,17 %

## XXXXXXXXXXXX

Thesaurierende Klasse EUR X	1,26 %	1,26 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,26 %	1,26 %

## US Equity

Thesaurierende Klasse JPY I3	1,01 %	0,72 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,22 %	1,70 %



## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### US Equity (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD I	1,36 %	0,95 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,49 %	0,95 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,95 %	2,50 %

##### US Equity Index PutWrite

Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,52 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,46 %	0,46 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,10 %	2,10 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I3	0,52 %	0,52 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	0,52 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,46 %	0,46 %
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,67 %	0,67 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,52 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,46 %	0,46 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,10 %	2,10 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,10 %	0,10 %

##### US Large Cap Value

Thesaurierende Klasse EUR A	1,61 %	1,61 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,61 %	1,61 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,78 %	0,78 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,77 %	0,77 %
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,49 %	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,43 %	0,43 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,81 %	0,81 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,81 %	0,81 %
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,81 %	0,81 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### US Large Cap Value (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,49 %	0,49 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse GBP P	0,76 %	0,76 %
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,72 %	0,72 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,58 %	1,58 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse USD I4	0,49 %	0,49 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,43 %	0,43 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,38 %	2,38 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,08 %	0,08 %

##### US Long Short Equity

Thesaurierende Klasse EUR A	2,40 %	2,40 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	1,09 %	1,09 %
Thesaurierende Klasse EUR M	3,19 %	3,19 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	1,09 %	1,09 %
Thesaurierende Klasse SGD A1	2,15 %	2,15 %
Thesaurierende Klasse USD A (PF)	1,84 %	1,84 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,39 %	2,39 %
Thesaurierende Klasse USD A1	2,14 %	2,14 %
Ausschüttende Klasse USD I (PF)	1,14 %	1,14 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse USD I3	1,08 %	1,08 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,19 %	3,19 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,94 %	1,94 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,15 %	0,15 %

##### US Multi Cap Opportunities

Thesaurierende Klasse AUD E	2,94 %	2,94 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,94 %	1,94 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,64 %	0,64 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,84 %	2,84 %
Thesaurierende Klasse EUR1 A	1,84 %	1,84 %
Thesaurierende Klasse EUR1 I	0,98 %	0,98 %
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	0,63 %	0,63 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,84 %	1,84 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,94 %	2,94 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,84 %	2,84 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,94 %	2,94 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,94 %	2,94 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,64 %	0,64 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,64 %	0,64 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,84 %	2,84 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,94 %	1,94 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,39 %	1,39 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,14 %	0,14 %
Thesaurierende Klasse USD1 A	1,84 %	1,84 %
Thesaurierende Klasse USD1 I	0,99 %	0,99 %
Ausschüttende Klasse USD1 I	0,99 %	0,99 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	2,94 %	2,94 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,94 %	2,94 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,94 %	1,94 %

##### US Real Estate Securities

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,73 %	1,73 %
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse AUD B	3,03 %	3,03 %
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	3,01 %	3,01 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse AUD E	3,03 %	3,03 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	2,03 %	2,03 %
Thesaurierende Klasse AUD T	2,03 %	2,03 %

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse CHF A	1,73 %	1,73 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,73 %	1,73 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,97 %	0,97 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,74 %	2,74 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,73 %	1,73 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,73 %	1,73 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,73 %	1,73 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,73 %	1,73 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,73 %	1,73 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse USD B	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,73 %	2,73 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse USD C2	3,03 %	3,03 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse USD E	3,03 %	3,03 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,98 %	0,98 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,73 %	2,73 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	2,03 %	2,03 %
Thesaurierende Klasse USD T	2,03 %	2,03 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,23 %	0,23 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	3,03 %	3,03 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	3,03 %	3,03 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	3,03 %	3,03 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	3,03 %	3,03 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	2,03 %	2,03 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	2,03 %	2,03 %

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

##### US Small Cap

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse AUD B	2,94 %	2,94 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	2,91 %	2,91 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,93 %	1,93 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,83 %	1,83 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,83 %	1,83 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,99 %	0,99 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,64 %	0,64 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,83 %	2,83 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,13 %	0,13 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,83 %	1,83 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,83 %	1,83 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,98 %	0,98 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,72 %	0,72 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,84 %	2,84 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,93 %	1,93 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,13 %	0,13 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,93 %	1,93 %

##### US Small Cap Intrinsic Value

Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,99 %	0,99 %
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	0,82 %	0,82 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,84 %	1,84 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,99 %	0,99 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,84 %	2,84 %

## Anhang II

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT)

## 5G Connectivity

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse AUD A	20.05.2020	IE00BMPRT94	42,40	3,58	(45,90)
Thesaurierende Klasse CNY A	01.02.2021	IE00BN13NY36	-	1,38	(43,77)
Thesaurierende Klasse EUR A	13.05.2020	IE00BMPRXP56	48,80	3,43	(45,94)
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	22.04.2020	IE00BMD7ZB71	38,10	12,60	(39,94)
Thesaurierende Klasse EUR I	30.06.2020	IE00BMPRXW24	35,80	4,27	(45,41)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	12.06.2020	IE00BLLXGX96	31,00	13,51	(39,41)
Thesaurierende Klasse EUR I5	01.09.2020	IE00BMPRXV17	21,50	4,69	(45,20)
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	22.04.2020	IE00BLLXH031	37,30	11,65	(40,38)
Thesaurierende Klasse GBP A	15.05.2020	IE00BMPRXS87	48,40	3,98	(45,24)
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	02.11.2020	IE00BKS9L945	14,60	6,46	(35,98)
Thesaurierende Klasse HKD A	13.05.2020	IE00BMPRXQ63	50,30	4,46	(43,95)
Thesaurierende Klasse SGD A	14.05.2020	IE00BMPRXR70	49,00	4,19	(44,38)
Thesaurierende Klasse USD A	04.05.2020	IE00BMPRXN33	54,60	4,59	(43,60)
Thesaurierende Klasse USD I	08.04.2020	IE00BLLXGV72	63,20	5,51	(43,15)
Ausschüttende Klasse USD I	08.04.2020	IE00BLLXGW89	63,10	5,52	(43,11)
Thesaurierende Klasse USD I2	10.03.2021	IE00BLR75G15	-	9,80	(42,99)
Thesaurierende Klasse USD I3	06.11.2020	IE00BNC26Z17	10,30	5,80	(43,02)
Thesaurierende Klasse USD I5	07.05.2020	IE00BLLXGY04	50,00	5,93	(42,92)
Thesaurierende Klasse USD M	02.06.2020	IE00BMCTKC00	38,60	3,68	(44,05)
Thesaurierende Klasse USD Z	19.03.2021	IE00BMG4Q780	-	8,80	(42,65)

## Absolute Return Multi Strategy\*

Thesaurierende Klasse CHF I	06.02.2014	IE00BDZTLL02	3,78	-	-
Thesaurierende Klasse EUR A	22.04.2014	IE00BDZTLS70	3,33	-	-
Thesaurierende Klasse EUR I	12.02.2014	IE00BDZTLV00	4,18	-	-
Thesaurierende Klasse EUR I2	24.09.2015	IE00BDZTLX24	4,32	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00WB95T37	2,49	-	-
Thesaurierende Klasse EUR Z	01.05.2014	IE00BKKN0W00	4,88	-	-
Thesaurierende Klasse GBP Z	25.04.2014	IE00BKMMWF44	5,51	-	-
Ausschüttende Klasse JPY D	29.08.2014	IE00BNHL3T63	4,30	-	-
Thesaurierende Klasse JPY I	04.06.2014	IE00BF109W83	4,30	-	-
Thesaurierende Klasse USD A	04.12.2013	IE00BF10B228	5,09	-	-
Thesaurierende Klasse USD I	31.10.2013	IE00BF10B442	5,88	-	-
Thesaurierende Klasse USD Z	04.04.2014	IE00BFH59G15	6,63	-	-

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## Asian Debt - Hard Currency

Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	25.10.2019	IE00BYV1RM06	4,13	-	-
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	30.06.2015	IE00BYZS6L96	4,74	(1,87)	(13,91)
Thesaurierende Klasse USD A	30.06.2015	IE00BYZS6K89	4,75	(1,84)	(13,94)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse USD C1	15.10.2019	IE00BJ023P46	3,76	(2,86)	(14,82)
Thesaurierende Klasse USD I	30.06.2015	IE00BYZS6J74	5,42	(1,27)	(13,50)
Ausschüttende Klasse USD I	30.06.2015	IE00BYZS6M04	5,27	(1,23)	(13,41)
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	23.09.2022	IE000BMKOID8	-	-	2,30
Thesaurierende Klasse USD I4	23.09.2022	IE000D2XZZ12	-	-	2,30
Thesaurierende Klasse USD M	14.08.2019	IE00BF47N027	4,12	(2,45)	(14,48)
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	23.09.2022	IE000Q9JOU E2	-	-	2,10
Thesaurierende Klasse USD X	08.06.2021	IE00BN6JC501	-	(1,30)	(13,48)
Thesaurierende Klasse USD Z	12.12.2022	IE00BYTHKK92	-	-	0,10

#### China A-Share Equity

Thesaurierende Klasse CNY I	28.07.2020	IE00BLPHVV04	18,25	0,20	(22,68)
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28.07.2020	IE00BMD7Z068	27,50	2,35	(28,89)
Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28.07.2020	IE00BMD7Z175	27,50	2,35	(28,97)

#### China Bond

Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	04.11.2020	IE00BF4ZPF56	(4,15)	(0,72)	(6,70)
Ausschüttende Klasse CNY I	08.06.2018	IE00BYRQGM22	0,05	(0,05)	(6,13)
Thesaurierende Klasse CNY Z	08.09.2015	IE00BYRQQQ69	0,73	0,60	(5,51)
Thesaurierende Klasse EUR I	01.12.2020	IE00BN13NX29	0,40	(5,48)	-
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	20.02.2020	IE00BL1NNM70	(5,40)	9,83	-
Thesaurierende Klasse GBP I2	09.02.2021	IE00BNC26Y00	-	(3,10)	(7,12)
Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	30.06.2020	IE00BLP47244	(4,00)	-	-
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	12.03.2019	IE00BHXGRN56	4,78	3,49	(14,73)
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	08.09.2015	IE00BYQX7S71	7,30	2,07	(13,76)
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	06.08.2019	IE00BJ7WS850	5,72	-	-
Thesaurierende Klasse USD Z	29.03.2019	IE00BYRGQJ92	(0,86)	(2,13)	(6,32)
Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	10.04.2018	IE00BYRGQN39	7,98	2,74	(13,14)

#### China Equity

Thesaurierende Klasse CHF I	31.07.2015	IE00B63FQV68	17,81	(7,10)	(24,04)
Thesaurierende Klasse EUR A	14.07.2009	IE00B54BK812	17,10	(7,67)	(24,30)
Thesaurierende Klasse EUR I	14.07.2009	IE00B54BLX33	18,02	(7,00)	(23,71)
Thesaurierende Klasse EUR I4	13.03.2015	IE00BWB99W46	17,96	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BYNBZG85	15,91	-	-
Thesaurierende Klasse EUR Z	03.06.2014	IE00BKJ9MV22	19,31	(5,96)	(22,86)
Ausschüttende Klasse GBP A	21.05.2015	IE00BWB9BT54	17,28	(7,17)	(23,19)
Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	23.06.2014	IE00BMN94C76	17,32	(4,93)	-
Thesaurierende Klasse GBP I4	13.03.2015	IE00BWB9BR31	18,16	-	-
Ausschüttende Klasse GBP I4	25.03.2015	IE00BWB9BS48	18,20	-	-

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse HKD A	23.04.2015	IE00B5KQW063	20,02	-	-
Thesaurierende Klasse SGD A	01.12.2014	IE00B5MMRT66	18,32	(7,00)	(22,69)
Thesaurierende Klasse USD A	14.07.2009	IE00B543WZ88	19,86	(6,70)	(21,93)
Ausschüttende Klasse USD A	27.08.2014	IE00BPRC5H50	19,89	(6,67)	(21,94)
Thesaurierende Klasse USD I	14.07.2009	IE00B547N797	20,77	(6,01)	(21,33)
Thesaurierende Klasse USD I2	11.08.2014	IE00B8BY0V78	21,02	(5,80)	(21,13)
Ausschüttende Klasse USD I4	25.03.2015	IE00BWB9BW83	20,76	-	-
Thesaurierende Klasse USD M	27.05.2016	IE00BYVF7440	18,68	(7,63)	(22,70)
Thesaurierende Klasse USD U	27.06.2014	IE00BLSP6051	20,35	(6,31)	(21,63)
Thesaurierende Klasse USD Z	01.08.2014	IE00BKJ9MZ69	22,11	(4,94)	(20,48)

## CLO Income

Thesaurierende Klasse EUR A	09.06.2022	IE000BKR2PI0	-	-	(3,30)
Thesaurierende Klasse EUR I	12.07.2018	IE00BG7PQ018	5,62	6,56	(8,74)
Ausschüttende Klasse EUR I2	15.11.2018	IE00BD102V45	5,86	6,73	(8,68)
Ausschüttende Klasse GBP I2	15.11.2018	IE00BD102W51	5,03	7,49	(7,13)
Ausschüttende Klasse GBP I5	12.07.2018	IE00BD5KHL59	5,27	7,72	-
Thesaurierende Klasse GBP Z	12.12.2019	IE00BHR46W74	5,61	8,11	(6,55)
Thesaurierende Klasse SEK I	12.07.2018	IE00BG7P3L15	6,17	7,04	(8,25)
Thesaurierende Klasse USD A	09.06.2022	IE000I861U99	-	-	(1,70)
Thesaurierende Klasse USD I	12.07.2018	IE00BF4NG566	7,50	7,51	(6,91)
Ausschüttende Klasse USD I2	21.03.2019	IE00BHXGRM40	7,89	7,66	(6,82)
Ausschüttende Klasse USD I4	05.03.2020	IE00BK5C7W14	8,14	-	-
Ausschüttende Klasse USD I5	12.07.2018	IE00BG7P3H78	8,19	7,83	(6,54)
Thesaurierende Klasse USD Z	18.04.2019	IE00BG7PPZ91	8,40	8,37	(6,26)

Commodities<sup>1</sup>

Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	14.12.2022	IE000GZB3BM6	-	-	4,30
Thesaurierende Klasse GBP I5	29.03.2022	IE00079M4L01	-	-	(5,80)
Thesaurierende Klasse USD A	15.03.2022	IE000407KK00	-	-	(2,90)
Thesaurierende Klasse USD I	09.02.2022	IE000MVZ49F4	-	-	12,00
Thesaurierende Klasse USD I5	04.03.2022	IE0000TMDNF9	-	-	(2,20)
Thesaurierende Klasse USD M	14.04.2022	IE000D1UZ4M5	-	-	(10,90)
Thesaurierende Klasse USD Z	15.02.2022	IE000K7ZYIB8	-	-	11,64

## Corporate Hybrid Bond

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	23.09.2016	IE00BD5YX427	3,70	0,55	(13,56)
Thesaurierende Klasse CHF P	27.04.2017	IE00BD4H0K73	3,41	0,36	(14,46)
Ausschüttende Klasse CHF P	17.06.2016	IE00BDH834	3,40	0,37	(14,47)
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	18.07.2016	IE00BDH834	3,05	(0,05)	(14,72)



## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse EUR A	03.06.2016	IE00BYV1RN13	3,05	(0,08)	(14,66)
Thesaurierende Klasse EUR I	19.11.2015	IE00BZ090894	3,72	0,55	(14,13)
Ausschüttende Klasse EUR I	19.11.2015	IE00BZ090902	3,65	0,55	(14,14)
Thesaurierende Klasse EUR I2	03.02.2017	IE00BYVF7770	3,88	0,59	(14,00)
Ausschüttende Klasse EUR I2	24.12.2020	IE00BD37NF41	0,10	0,59	(14,03)
Thesaurierende Klasse EUR I3	13.09.2016	IE00BD3H7K78	3,84	0,67	(13,95)
Thesaurierende Klasse EUR I5	19.11.2015	IE00BZ090787	4,00	0,85	(13,87)
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BD9WHQ23	2,46	(0,70)	(15,13)
Ausschüttende Klasse EUR M	13.02.2017	IE00BZ0BMF67	2,40	(0,62)	(15,17)
Thesaurierende Klasse EUR P	27.04.2017	IE00BYVF7663	3,64	0,61	(14,14)
Ausschüttende Klasse EUR P	24.06.2016	IE00BD37ND27	3,68	0,49	(14,05)
Thesaurierende Klasse GBP I	09.03.2017	IE00BYMJ8V99	4,10	1,17	(12,75)
Thesaurierende Klasse GBP I2	15.05.2017	IE00BDRKGS35	4,27	1,28	(12,63)
Ausschüttende Klasse GBP I2	24.08.2016	IE00BZCPRS46	4,19	1,28	(12,63)
Thesaurierende Klasse GBP P	16.08.2019	IE00BH3W6W54	4,17	1,21	(12,71)
Ausschüttende Klasse GBP P	19.05.2017	IE00BD4H0M97	4,13	1,23	(12,77)
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	31.10.2019	IE00BJR5T254	5,05	-	-
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	02.08.2019	IE00BJR5T361	4,11	0,77	(13,05)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	18.07.2016	IE00BDHBBH610	4,87	0,74	(12,77)
Thesaurierende Klasse USD A	10.08.2016	IE00BD0PCH68	4,86	0,79	(12,79)
Ausschüttende Klasse USD A	23.04.2021	IE00BMT63Q97	-	0,22	(12,83)
Thesaurierende Klasse USD C1	13.12.2017	IE00BDFBJ677	3,79	(0,27)	(13,67)
Thesaurierende Klasse USD I	14.06.2016	IE00BDHBBH503	5,47	1,37	(12,29)
Ausschüttende Klasse USD I	23.04.2021	IE00BMCIFY00	-	0,58	(12,28)
Thesaurierende Klasse USD I2	03.02.2017	IE00BDRKGR28	5,64	1,47	(12,20)
Ausschüttende Klasse USD I2	03.02.2017	IE00BD37NK93	5,70	1,45	(12,20)
Thesaurierende Klasse USD M	15.12.2017	IE00BDFBLB65	4,31	0,09	(13,36)
Ausschüttende Klasse USD M	15.12.2017	IE00BDFBJ784	4,21	0,15	(13,35)
Thesaurierende Klasse USD P	05.05.2017	IE00BD4H0L80	5,46	1,46	(12,28)
Thesaurierende Klasse USD Z	20.01.2017	IE00BZ56PT19	6,13	1,98	(11,77)

#### Diversified Currency\*

Thesaurierende Klasse EUR I	25.02.2009	IE00B3L3LX87	(1,95)	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BD9WHT53	(2,98)	-	-
Thesaurierende Klasse USD A	08.12.2009	IE00B3L3LT42	(0,94)	-	-
Thesaurierende Klasse USD I	25.02.2009	IE00B3L3LS35	(0,44)	-	-

\* Das Portfolio wurde am 22. Januar 2021 aufgelöst.

#### Emerging Market Debt - Hard Currency

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	26.02.2019	IE00BF0K7B44	2,93	(4,41)	(20,61)
--	------------	--------------	------	--------	---------

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Ausschüttende Klasse AUD I	26.05.2020	IE00B986FB81	13,00	(3,74)	(20,07)
Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	31.10.2022	IE000ESKKWI7	-	-	10,40
Thesaurierende Klasse CHF I2	13.01.2020	IE00BKKL6823	3,93	(4,39)	(21,12)
Thesaurierende Klasse CHF P	24.01.2018	IE00BFNPGF37	3,29	(4,44)	(21,23)
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	16.04.2018	IE00B986FR42	2,83	(5,06)	(21,52)
Thesaurierende Klasse EUR A	31.05.2013	IE00B986FT65	2,73	(4,93)	(21,63)
Thesaurierende Klasse EUR I	31.05.2013	IE00B986G486	3,49	(4,25)	(21,06)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	17.09.2019	IE00BK5V1269	(3,06)	3,97	(13,70)
Ausschüttende Klasse EUR I	07.10.2016	IE00B986GB56	3,45	(4,36)	(21,04)
Thesaurierende Klasse EUR I2	18.12.2019	IE00B986GC63	3,59	(4,14)	(20,98)
Ausschüttende Klasse EUR I2	06.11.2019	IE00BK6H5655	3,68	(4,16)	(21,02)
Thesaurierende Klasse EUR I3	29.07.2016	IE00BD0PCJ82	3,65	(4,12)	(20,88)
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	06.09.2019	IE00BJ7VWB39	(2,80)	4,12	(13,44)
Ausschüttende Klasse EUR I3	12.03.2019	IE00BJ2JSZ87	3,74	(4,09)	-
Thesaurierende Klasse EUR I4	10.12.2015	IE00BXQ9CQ11	3,79	(4,04)	(20,87)
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	05.07.2022	IE000EFK10A5	-	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BSNLZN33	1,92	(5,73)	(22,24)
Ausschüttende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BSNLZP56	1,89	(5,75)	(22,23)
Thesaurierende Klasse EUR P	23.01.2018	IE00BFNPGG44	3,53	(4,26)	(21,07)
Thesaurierende Klasse EUR Z	29.12.2017	IE00BKJB1B19	4,25	(3,61)	(20,56)
Thesaurierende Klasse GBP I	16.12.2016	IE00BDDNB708	3,77	(3,72)	(19,88)
Ausschüttende Klasse GBP I	21.02.2018	IE00BZ1D2402	3,84	(3,73)	(19,86)
Thesaurierende Klasse GBP I2	26.01.2018	IE00B986H344	3,83	(3,60)	(19,71)
Ausschüttende Klasse GBP I2	06.07.2015	IE00B986H450	3,91	(3,60)	(19,77)
Thesaurierende Klasse GBP P	14.03.2018	IE00BF0V1041	3,84	(3,70)	(19,85)
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	09.01.2019	IE00BF0K7C50	5,17	(4,16)	(19,74)
Thesaurierende Klasse JPY I	11.12.2017	IE00BD4H0D07	3,88	(3,84)	(21,02)
Thesaurierende Klasse SEK A	05.11.2015	IE00BYSW3F11	2,76	(4,71)	(21,55)
Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)	14.04.2020	IE00BLDG8V83	2,49	6,54	-
Thesaurierende Klasse SEK I2	19.05.2021	IE00BN92ZN54	-	(2,00)	(20,89)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	17.02.2015	IE00B99K3R14	4,13	(4,10)	(19,90)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B986J720	4,85	(4,04)	(19,53)
Thesaurierende Klasse USD A	31.05.2013	IE00B986J944	4,97	(4,05)	(19,51)
Ausschüttende Klasse USD A	30.10.2020	IE00B986JM76	7,30	(4,01)	(19,54)
Thesaurierende Klasse USD C1	24.08.2017	IE00BDFBJ891	3,81	(5,02)	(20,28)
Thesaurierende Klasse USD I	31.05.2013	IE00B99K4563	5,64	(3,32)	(18,98)
Ausschüttende Klasse USD I	31.05.2013	IE00B99K4670	5,61	(3,34)	(18,95)
Thesaurierende Klasse USD I2	15.11.2016	IE00B99K6R29	5,81	(3,23)	(18,80)
Ausschüttende Klasse USD I2	20.04.2018	IE00B99K6W71	5,80	(3,24)	(18,74)
Ausschüttende Klasse USD I3	20.03.2019	IE00BCFFTG28	5,85	(3,14)	(18,77)
Ausschüttende Klasse USD I4	24.02.2020	IE00BXQ9CT42	2,92	-	-

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BDFBJ909	3,99	(4,82)	(20,15)
Ausschüttende Klasse USD M	15.09.2017	IE00BDFBJB28	4,05	(4,74)	(20,22)
Thesaurierende Klasse USD P	11.01.2018	IE00BTKH9G20	5,65	(3,33)	(18,86)
Thesaurierende Klasse USD X	16.12.2021	IE000BX4CH70	-	0,30	(18,74)
Thesaurierende Klasse USD Z	26.04.2017	IE00BD4H0C99	6,41	(2,70)	(18,34)

#### Emerging Market Debt - Local Currency

Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	04.06.2015	IE00BLWS819	(2,21)	(11,82)	(15,78)
Thesaurierende Klasse AUD B	04.06.2015	IE00BLWS702	(2,10)	(11,87)	(15,89)
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	04.06.2015	IE00BLWSB42	(2,04)	(12,16)	(15,84)
Thesaurierende Klasse AUD C2	04.06.2015	IE00BLWS926	(2,10)	(11,96)	(15,91)
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	04.06.2015	IE00BLWSD65	(2,19)	(11,78)	(15,97)
Thesaurierende Klasse AUD E	04.06.2015	IE00BLWSC58	(2,10)	(11,88)	(15,91)
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	04.06.2015	IE00BLWSG96	(1,15)	(10,95)	(15,20)
Thesaurierende Klasse AUD T	04.06.2015	IE00BLWSF89	(1,18)	(10,97)	(15,01)
Thesaurierende Klasse EUR A	28.06.2013	IE00B975F382	(1,02)	(11,12)	(15,87)
Thesaurierende Klasse EUR I	28.06.2013	IE00B975F507	(0,32)	(10,42)	(15,27)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	27.06.2017	IE00BD5BKF38	(6,51)	(2,55)	(7,15)
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	29.12.2015	IE00BZ1J8T56	(6,33)	(2,42)	(7,10)
Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	12.03.2019	IE00BJ2JSW56	(6,24)	(2,33)	-
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	14.03.2017	IE00BYX7M324	(6,18)	(2,29)	(6,87)
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	29.03.2019	IE00BHR06699	(6,08)	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	18.02.2016	IE00BD9WJ778	(7,90)	-	-
Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	18.02.2016	IE00BD9WJ885	(7,90)	(3,99)	-
Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)	25.01.2021	IE00BMY4BL92	-	(1,10)	(6,77)
Thesaurierende Klasse GBP I	22.09.2017	IE00BDZRNT61	-	(9,84)	(13,95)
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	02.11.2016	IE00BYX4Q207	(0,92)	(8,30)	(1,63)
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	02.11.2016	IE00BYSW3D96	(0,84)	(8,32)	(1,63)
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	17.09.2018	IE00BFNPGD13	(0,85)	-	-
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	25.01.2021	IE00BMY4BM00	-	(6,40)	(1,50)
Thesaurierende Klasse SEK A	05.11.2015	IE00BYSW3401	(1,82)	(10,94)	(15,78)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	04.03.2015	IE00B99K6K59	0,36	(10,26)	(14,02)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B99K7G88	1,18	(10,19)	(13,38)
Thesaurierende Klasse USD A	28.06.2013	IE00B99K7H95	1,21	(10,19)	(13,46)
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	04.06.2015	IE00BLWSH04	(0,20)	(11,35)	(14,56)
Thesaurierende Klasse USD B	04.06.2015	IE00B99K7M49	(0,09)	(11,28)	(14,64)
Thesaurierende Klasse USD C1	03.11.2017	IE00BDFBJG72	0,19	-	-
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	04.06.2015	IE00BLWWSJ28	(0,20)	(11,35)	(14,56)
Thesaurierende Klasse USD C2	04.06.2015	IE00B99K7Z77	(0,09)	(11,36)	(14,64)
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	04.06.2015	IE00BLWWSL40	(0,20)	(11,35)	(14,56)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse USD E	04.06.2015	IE00BTLWSK33	(0,19)	(11,28)	(14,64)
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	02.09.2021	IE00080NF9F1	-	(6,22)	(12,87)
Thesaurierende Klasse USD I	28.06.2013	IE00B9Z1CL57	1,92	(9,35)	(12,92)
Ausschüttende Klasse USD I	14.10.2016	IE00BYT43784	1,98	(9,46)	(12,85)
Thesaurierende Klasse USD I2	13.08.2014	IE00B9Z1CN71	2,09	(9,27)	(12,69)
Thesaurierende Klasse USD I5	26.09.2018	IE00BYNVFZ74	2,32	(9,97)	(15,46)
Ausschüttende Klasse USD M	01.08.2019	IE00BDFBJJ04	0,42	-	-
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31.03.2016	IE00BTLWSM56	0,73	(10,34)	(13,76)
Thesaurierende Klasse USD T	04.06.2015	IE00B9Z1CQ03	0,90	(10,40)	(13,81)
Thesaurierende Klasse USD X	23.10.2013	IE00B9Z1CS27	2,47	(9,05)	(12,49)
Thesaurierende Klasse USD Y	14.01.2021	IE00BMY4BK85	-	(8,20)	(12,53)
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSP87	2,18	(8,00)	(12,08)
Thesaurierende Klasse ZAR B	05.06.2015	IE00BTLWSN63	2,26	(8,01)	(12,11)
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSR02	2,17	(8,01)	(12,07)
Thesaurierende Klasse ZAR C2	05.06.2015	IE00BTLWSQ94	2,26	(8,01)	(12,10)
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSS19	2,17	(8,02)	(12,07)
Thesaurierende Klasse ZAR E	05.06.2015	IE00BTLWST26	2,26	(8,02)	(12,10)
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSW54	3,21	(7,07)	(11,19)
Thesaurierende Klasse ZAR T	05.06.2015	IE00BTLWSV48	3,28	(7,07)	(11,23)

## Emerging Market Debt Blend

Ausschüttende Klasse AUD I3	06.11.2019	IE00BKPHZ39	(1,93)	(2,90)	(11,15)
Thesaurierende Klasse EUR A	04.12.2015	IE00BK4YZ020	(2,71)	(3,48)	(12,89)
Thesaurierende Klasse EUR I	08.07.2014	IE00BK4YYZ03	(2,02)	(2,75)	(12,29)
Ausschüttende Klasse EUR I	19.06.2015	IE00BY7S2G49	(2,13)	(2,70)	(12,26)
Thesaurierende Klasse EUR I2	27.05.2014	IE00BMMV6Y07	(1,89)	(2,60)	(12,16)
Ausschüttende Klasse EUR I2	24.02.2015	IE00BMMV6Z14	(1,95)	(2,62)	(12,21)
Ausschüttende Klasse EUR I3	05.11.2019	IE00BLDYHM63	(1,86)	(2,56)	(12,11)
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	23.03.2017	IE00BD3WDH16	(5,06)	1,71	(8,23)
Thesaurierende Klasse EUR I5	23.04.2014	IE00BLDYHL56	(1,73)	(2,47)	(11,95)
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSNLZD35	(3,51)	(4,26)	(13,62)
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSNLZF58	(3,44)	(4,28)	(13,51)
Thesaurierende Klasse EUR Z	02.06.2014	IE00BKKN1384	(1,36)	(2,11)	(11,69)
Thesaurierende Klasse GBP I	31.03.2016	IE00BK4YYR29	0,98	(5,56)	(9,05)
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	12.04.2017	IE00BD3WDG09	-	(4,91)	(3,22)
Ausschüttende Klasse GBP I	22.05.2018	IE00BK4YYW71	0,95	(5,52)	(9,08)
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22.05.2018	IE00BFOV1488	0,10	(5,00)	(3,16)
Thesaurierende Klasse GBP P	13.05.2019	IE00BGPZW838	0,84	(5,44)	(9,06)
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	13.05.2019	IE00BGPZW721	0,09	(4,95)	(3,24)
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BKKN1509	1,61	(4,83)	(8,41)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse NOK U	13.03.2017	IE00BZCPRQ22	1,19	(5,03)	(9,72)
Thesaurierende Klasse SEK A	05.11.2015	IE00BMN92P65	(4,85)	(2,08)	(9,24)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BMN93084	1,27	(5,70)	(15,04)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJTF125	2,48	(6,53)	(14,64)
Thesaurierende Klasse USD A	04.02.2016	IE00BK4YYX88	2,66	(6,47)	(14,65)
Thesaurierende Klasse USD C1	24.08.2017	IE00BDFBKG46	1,45	(7,41)	(15,50)
Thesaurierende Klasse USD I	23.04.2014	IE00BK4YYS36	3,22	(5,83)	(14,12)
Ausschüttende Klasse USD I	01.06.2016	IE00BK4YYT43	3,24	(5,85)	(13,98)
Thesaurierende Klasse USD I2	24.09.2014	IE00BMN93423	11,01	(5,65)	-
Ausschüttende Klasse USD I2	24.02.2015	IE00BMN93530	3,46	(5,73)	(13,96)
Thesaurierende Klasse USD I3	20.12.2017	IE00BD21NN56	3,46	(5,61)	(13,90)
Thesaurierende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BF46ZC54	1,64	(7,20)	(15,32)
Ausschüttende Klasse USD M	26.09.2017	IE00BDFBKH52	1,70	(7,18)	(15,37)
Thesaurierende Klasse USD Z	28.09.2015	IE00BKKN1616	4,01	(5,19)	(13,46)

#### Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Thesaurierende Klasse AUD I2	16.02.2021	IE00BM909D01	-	(0,70)	(12,69)
Thesaurierende Klasse NOK I	09.05.2018	IE00BYT26W83	6,42	(4,07)	(11,43)
Thesaurierende Klasse USD I	10.07.2017	IE00BD3DV032	8,73	(4,96)	(14,33)
Thesaurierende Klasse USD I2	16.03.2021	IE00BMXC7C74	-	0,40	(14,24)
Thesaurierende Klasse USD I5	10.07.2017	IE00BD3DV693	8,84	-	-
Thesaurierende Klasse USD Z	02.11.2017	IE00BD3DV362	9,42	(4,39)	(13,84)

#### Emerging Markets Equity

Thesaurierende Klasse AUD B	30.11.2016	IE00BYN4NY18	8,39	(7,37)	(27,37)
Thesaurierende Klasse AUD C2	30.11.2016	IE00BYN4NZ25	8,47	(7,44)	(27,37)
Thesaurierende Klasse AUD E	30.11.2016	IE00BYN4P011	8,47	(7,44)	(27,39)
Thesaurierende Klasse AUD T	30.11.2016	IE00BYN4P128	9,45	(6,44)	(26,70)
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	24.01.2018	IE00BF8P8L84	12,05	(5,42)	(18,34)
Ausschüttende Klasse CAD I2	17.12.2021	IE000TTJ7N81	-	1,60	(24,79)
Thesaurierende Klasse EUR I	04.10.2010	IE00B3SRML86	11,24	(5,58)	(26,37)
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BWB99R92	9,08	(7,51)	(27,80)
Thesaurierende Klasse EUR Z	05.02.2018	IE00BKJ9SM50	12,40	(4,65)	(25,58)
Thesaurierende Klasse GBP I	15.01.2014	IE00B3SC5588	11,15	(5,09)	(25,19)
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BKJ9SX65	12,27	(4,14)	(24,48)
Thesaurierende Klasse JPY I	04.10.2010	IE00B6780209	8,38	6,37	-
Thesaurierende Klasse USD A	04.10.2010	IE00B3M56506	12,94	(5,58)	(24,66)
Thesaurierende Klasse USD B	30.11.2016	IE00BYN4P235	11,83	(6,52)	(25,34)
Thesaurierende Klasse USD C1	15.09.2017	IE00BDFBKJ76	11,78	-	-
Thesaurierende Klasse USD C2	30.11.2016	IE00BYN4P342	11,75	(6,59)	(25,36)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse USD E	30.11.2016	IE00BYN4P458	11,83	(6,59)	(25,43)
Thesaurierende Klasse USD I	04.10.2010	IE00B3NBSZ12	14,15	(4,63)	(23,86)
Thesaurierende Klasse USD M	27.05.2016	IE00BYQQ4J61	11,76	(6,51)	(25,40)
Thesaurierende Klasse USD T	30.11.2016	IE00BYN4P565	12,91	(5,58)	(24,72)
Thesaurierende Klasse USD Z	30.06.2014	IE00BKJ9TD35	15,21	(3,66)	(23,12)
Thesaurierende Klasse ZAR B	30.11.2016	IE00BYN4P672	13,24	(3,05)	(23,78)
Thesaurierende Klasse ZAR C2	30.11.2016	IE00BYN4P789	13,24	(3,05)	(23,79)
Thesaurierende Klasse ZAR E	30.11.2016	IE00BYN4P896	13,24	(3,05)	(23,78)
Thesaurierende Klasse ZAR T	30.11.2016	IE00BYN4P904	14,38	(2,08)	(23,02)

## Emerging Markets Select Equity

Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	08.01.2020	IE00BKLC3T45	5,50	3,13	(20,04)
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	03.12.2018	IE00BG365X48	10,66	6,94	(14,04)
Thesaurierende Klasse USD I	24.10.2017	IE00BZ3CFW46	16,49	(4,07)	(25,02)
Ausschüttende Klasse USD I	24.10.2017	IE00BZ3CFV39	16,57	(4,13)	-
Thesaurierende Klasse USD I5	22.11.2017	IE00BZ3CFZ76	17,00	(3,74)	(24,71)

## Euro Bond Absolute Return

Thesaurierende Klasse EUR I	29.11.2018	IE00BFZMG962	2,69	3,27	(4,71)
Ausschüttende Klasse EUR I	29.11.2018	IE00BFZMGB89	2,73	3,19	(4,58)
Thesaurierende Klasse EUR I5	28.03.2019	IE00BGL9FP72	2,89	3,47	(4,44)
Thesaurierende Klasse USD Z	22.11.2019	IE00BHXMF734	4,84	4,61	(2,25)

## Euro Opportunistic Bond

Thesaurierende Klasse EUR I	14.11.2018	IE00BD9GYJ62	7,05	0,94	(15,59)
Ausschüttende Klasse EUR I	14.11.2018	IE00BFZMGH42	7,12	0,94	(15,68)

## European High Yield Bond

Thesaurierende Klasse EUR A	04.02.2016	IE00BNH72N19	3,57	-	-
Thesaurierende Klasse EUR I	27.06.2014	IE00BNH72V92	4,12	3,88	(9,53)
Thesaurierende Klasse EUR I5	10.04.2015	IE00BNH73052	4,49	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSNLZ880	2,92	2,60	(10,59)
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSNLZ997	3,00	-	-
Thesaurierende Klasse EUR X	20.02.2018	IE00BD2B9W69	4,67	4,20	(9,15)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	09.05.2019	IE00BNH73D85	3,74	3,98	-
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BNH73J48	5,60	4,06	(8,12)
Thesaurierende Klasse USD A	10.01.2018	IE00BNH73H24	5,52	-	-
Thesaurierende Klasse USD I	27.06.2014	IE00BNH73L69	6,14	4,69	(7,54)
Thesaurierende Klasse USD I5	07.10.2019	IE00BY99SH32	6,47	-	-
Thesaurierende Klasse USD X	12.01.2018	IE00BD2B9Y83	6,61	5,06	(7,15)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### European Sustainable Equity<sup>2</sup>

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	2020			2021			2022		
			%			%			%		
Thesaurierende Klasse USD Z	26.04.2019	IE00BPT29L50	6,79			5,31			(6,95)		
Ausschüttende Klasse EUR A	12.01.2022	IE000YS2J411	-			-			(20,70)		
Thesaurierende Klasse EUR I	24.02.2021	IE00BMQC7246	-			21,40			(24,96)		
Ausschüttende Klasse EUR I	24.02.2021	IE00BMQC7B38	-			21,50			(25,02)		
Ausschüttende Klasse EUR I3	07.10.2021	IE000S1PE6L2	-			3,70			(24,86)		
Thesaurierende Klasse EUR I5	20.07.2021	IE00BM9TKM36	-			5,70			(24,69)		
Thesaurierende Klasse EUR M	24.02.2021	IE00BMG4Q673	-			19,70			(26,23)		
Thesaurierende Klasse EUR Z	29.03.2021	IE00BKP80429	-			20,90			(24,57)		
Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	15.03.2021	IE00BPKM643	-			15,00			(30,17)		
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	15.03.2021	IE00BNC01617	-			15,80			(29,62)		
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	15.03.2021	IE00BPKM536	-			14,30			(30,80)		

#### Event Driven<sup>1</sup>

Thesaurierende Klasse GBP I5	26.10.2022	IE0004B8PGL9	-			-			1,10		
Ausschüttende Klasse GBP I5	26.10.2022	IE000TEWJNL5	-			-			1,10		
Thesaurierende Klasse GBP P	26.10.2022	IE000TQXBRW2	-			-			1,00		
Thesaurierende Klasse USD I	26.10.2022	IE000F96D003	-			-			1,20		
Thesaurierende Klasse USD I5	26.10.2022	IE00033HFZ64	-			-			1,30		

#### Global Bond

Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	03.02.2021	IE00BMH55D96	-			(5,90)			(17,25)		
Thesaurierende Klasse USD A	04.02.2016	IE00B87J3J52	9,43			-			-		
Thesaurierende Klasse USD C1	03.01.2018	IE00B8H49690	8,40			(6,20)			(16,72)		
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	26.09.2022	IE000028YR76	-			-			1,80		
Thesaurierende Klasse USD I	16.07.2012	IE00B8GFHY73	9,89			(4,83)			(15,67)		
Thesaurierende Klasse USD M	02.07.2018	IE00BDFBKC08	8,75			(5,86)			(16,36)		
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	03.02.2021	IE00BMH55G28	-			(4,27)			(16,15)		
Thesaurierende Klasse USD Z	20.01.2017	IE00BKJ9T774	10,33			(4,48)			(15,41)		
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	03.02.2021	IE00BMH55J58	-			(1,69)			(13,12)		

#### Global Diversified Income FMP – 2024

Thesaurierende Klasse EUR A	07.07.2020	IE00BL1NN727	4,60			(1,24)			(6,39)		
Ausschüttende Klasse EUR A	10.07.2020	IE00BL1NN834	4,80			(1,25)			(6,28)		
Ausschüttende Klasse EUR I	29.07.2020	IE00BL1NNB65	3,40			(0,72)			(6,00)		
Ausschüttende Klasse GBP I	22.06.2020	IE00BK5C7S77	5,10			(0,06)			(4,41)		
Ausschüttende Klasse HKD A	28.07.2020	IE00BL1NN271	3,80			(0,46)			(4,88)		
Ausschüttende Klasse SGD A	22.06.2020	IE00BL1NNG11	5,00			(0,35)			(4,56)		
Thesaurierende Klasse USD A	22.06.2020	IE00BL1NMV96	5,10			(0,38)			(4,39)		
Ausschüttende Klasse USD A	22.06.2020	IE00BL1NMW04	5,10			(0,41)			(4,28)		
Thesaurierende Klasse USD I	22.06.2020	IE00BL1NMX11	5,30			0,00			(3,99)		

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Ausschüttende Klasse USD I	22.06.2020	IE00BL1NMY28	5,30	0,01	(3,99)
Thesaurierende Klasse USD X	22.06.2020	IE00BL1NMZ35	5,30	0,00	(4,08)
Ausschüttende Klasse USD X	22.06.2020	IE00BL1NN057	5,30	(0,06)	(3,94)

## Global Equity Index PutWrite\*

Thesaurierende Klasse CHF I5	13.06.2017	IE00BYPFK747	2,17	-	-
Ausschüttende Klasse CHF I5	24.07.2017	IE00BF2D6P81	2,08	-	-
Thesaurierende Klasse EUR I	13.11.2017	IE00BD4H0F21	2,12	-	-
Thesaurierende Klasse EUR I5	25.05.2017	IE00BYWPKL13	2,43	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	30.05.2017	IE00BD4H0G38	0,61	-	-
Thesaurierende Klasse EUR X	13.06.2017	IE00BF0P1171	1,60	-	-
Thesaurierende Klasse EUR Z	16.06.2017	IE00BF5M5113	2,71	-	-
Thesaurierende Klasse GBP I	12.07.2017	IE00BF0K7819	2,21	-	-
Thesaurierende Klasse USD A	30.05.2017	IE00BYWPKH76	3,53	-	-
Thesaurierende Klasse USD I	03.05.2017	IE00BYWPKF52	4,08	-	-
Ausschüttende Klasse USD I5 (Monatlich)	13.06.2017	IE00BF0P1C89	4,60	-	-
Thesaurierende Klasse USD I5	13.06.2017	IE00BYWPKK06	4,55	-	-
Ausschüttende Klasse USD I5	13.06.2017	IE00BYPFK853	4,54	-	-
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	13.06.2017	IE00BF0P1B72	3,65	-	-
Thesaurierende Klasse USD X	13.06.2017	IE00BF0P1734	3,72	-	-
Thesaurierende Klasse USD Z	18.08.2017	IE00BYWPKJ90	4,92	-	-

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## Global Equity Megatrends

Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	19.10.2018	IE00BFZ89Z14	2,36	24,90	(9,70)
Thesaurierende Klasse USD A	27.04.2018	IE00BFMHRM44	12,70	17,07	(14,51)
Thesaurierende Klasse USD C1	27.04.2018	IE00BFMHRS06	11,52	15,95	(15,40)
Thesaurierende Klasse USD I	27.04.2018	IE00BFMHRK20	13,83	18,26	(13,78)
Thesaurierende Klasse USD M	27.04.2018	IE00BFMHRT13	11,52	16,03	(15,24)
Thesaurierende Klasse USD Z	25.02.2022	IE00BFMHRN50	-	-	(12,30)

## Global Flexible Credit Income

Thesaurierende Klasse CAD I5	18.03.2021	IE00BMDQ4176	-	3,90	(10,11)
Thesaurierende Klasse EUR I	29.09.2020	IE00BKPV7063	7,70	2,23	(11,99)
Thesaurierende Klasse EUR I5	01.07.2020	IE00BKPV7626	11,20	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	13.08.2020	IE00BKPV6Z45	5,80	0,85	(13,31)
Thesaurierende Klasse GBP I5	01.06.2020	IE00BMD7Z951	13,30	3,27	(10,34)
Thesaurierende Klasse USD A	16.09.2020	IE00BKPV6V07	6,10	2,54	(10,48)
Thesaurierende Klasse USD I	01.06.2020	IE00BMD7Z621	13,40	3,17	(9,91)



## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Ausschüttende Klasse USD I	01.06.2020	IE00BMD7Z738	13,44	3,10	(9,89)
Thesaurierende Klasse USD M	16.09.2020	IE00BKPV6Y38	5,90	1,61	(11,15)
Thesaurierende Klasse USD Z	01.06.2020	IE00BMD7Z845	13,80	3,78	(9,40)

#### Global High Yield SDG Engagement

Ausschüttende Klasse AUD I	03.05.2022	IE00BLRPMZ33	-	-	(5,65)
Thesaurierende Klasse CHF I4	03.05.2022	IE000NWK9054	-	-	(4,70)
Ausschüttende Klasse CHF I4	03.05.2022	IE000FKA7HA8	-	-	(4,70)
Thesaurierende Klasse CHF X	03.05.2022	IE000UJH5394	-	-	(5,10)
Thesaurierende Klasse EUR I4	03.05.2022	IE000FQ3GMZ6	-	-	(4,90)
Ausschüttende Klasse EUR I4	03.05.2022	IE000R3WKJZ3	-	-	(4,87)
Thesaurierende Klasse EUR X	03.05.2022	IE000BDJ74G5	-	-	(5,40)
Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	04.08.2016	IE00BD0PCC14	3,40	3,38	(12,82)
Thesaurierende Klasse GBP I4	03.05.2022	IE000HVII8Q5	-	-	(3,70)
Thesaurierende Klasse GBP X	03.05.2022	IE000OOR7613	-	-	(4,10)
Thesaurierende Klasse USD A	16.08.2016	IE00BZ090126	4,38	3,15	(11,66)
Thesaurierende Klasse USD C1	27.08.2019	IE00BDFBKK81	3,28	-	-
Thesaurierende Klasse USD I	04.08.2016	IE00BYMW5M88	5,06	3,73	(11,16)
Thesaurierende Klasse USD I4	03.05.2022	IE0003AEEC94	-	-	(3,00)
Thesaurierende Klasse USD M	07.08.2019	IE00BDFBKL98	3,74	-	-
Ausschüttende Klasse USD M	29.01.2018	IE00BDFBKM06	3,70	2,50	(12,19)
Thesaurierende Klasse USD P	09.01.2018	IE00BFNPGC06	5,04	-	-
Thesaurierende Klasse USD X	10.11.2020	IE00BNC27034	3,20	4,26	(11,43)
Thesaurierende Klasse USD Z	04.08.2016	IE00BD0PC768	5,60	4,39	(10,66)

#### Global High Yield Sustainable Action

Thesaurierende Klasse USD I	21.01.2020	IE00BL3NDN61	3,30	2,81	(11,49)
Ausschüttende Klasse USD I	21.01.2020	IE00BL3NDP85	3,36	2,74	(11,52)
Thesaurierende Klasse USD X	10.11.2020	IE00BNC27141	1,30	3,16	(11,20)
Thesaurierende Klasse USD Y	25.02.2021	IE00BMDQ4283	-	2,80	(11,19)

#### Global Investment Grade Credit<sup>2</sup>

Thesaurierende Klasse USD I	01.09.2021	IE00BN6JC279	-	(1,20)	(14,57)
Thesaurierende Klasse USD X	01.09.2021	IE00BN6JC386	-	(1,20)	(14,37)
Thesaurierende Klasse USD Z	01.09.2021	IE00BN6JC493	-	(1,10)	(14,36)

#### Global Opportunistic Bond

Thesaurierende Klasse EUR I	27.11.2020	IE00BNDQ3Y07	0,70	0,10	(13,49)
Thesaurierende Klasse GBP P	16.01.2020	IE00BJXCZR70	5,10	0,76	(12,09)
Thesaurierende Klasse USD A	22.09.2017	IE00BD3WF316	6,26	0,43	(11,82)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse USD C1	01.07.2019	IE00BF47NL31	5,23	-	-
Thesaurierende Klasse USD I	20.12.2016	IE00BD3WD824	6,63	0,82	(11,44)
Ausschüttende Klasse USD I	20.12.2016	IE00BD3WD931	6,64	0,81	(11,52)
Thesaurierende Klasse USD I2	23.04.2018	IE00BF0V1595	6,85	0,87	(11,42)
Thesaurierende Klasse USD M	18.12.2019	IE00BF47NM48	5,59	(0,09)	-
Thesaurierende Klasse USD Z	16.05.2019	IE00BD3WDB53	7,09	1,25	(11,23)

## Global Real Estate Securities

Ausschüttende Klasse EUR I5	08.07.2021	IE00068K7LS0	-	9,00	(27,80)
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BYNBZ117	(8,09)	24,20	(29,30)
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	04.11.2020	IE00BLP47350	1,70	38,35	(20,04)
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BSPPW214	(6,42)	27,93	(26,55)
Thesaurierende Klasse USD A	09.05.2019	IE00BSPPW651	(4,55)	26,67	(26,09)
Thesaurierende Klasse USD CI	08.01.2020	IE00BF47NP78	(4,50)	25,45	(26,79)
Thesaurierende Klasse USD I	30.12.2014	IE00BSPPW875	(3,79)	27,63	(25,56)
Thesaurierende Klasse USD I2	29.11.2017	IE00BSPPWB00	(3,62)	-	-
Ausschüttende Klasse USD I5	20.12.2019	IE00BL4KJW74	(3,42)	28,03	(25,27)
Thesaurierende Klasse USD M	02.10.2019	IE00BF47NQ85	(5,50)	25,54	(26,85)
Thesaurierende Klasse USD Z	13.02.2015	IE00BSPPWG54	(3,07)	28,64	(24,96)

Global Sustainable Equity<sup>2</sup>

Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	24.02.2021	IE00BL5BFR67	-	31,80	(23,37)
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	24.02.2021	IE00BMG4Q566	-	29,60	(24,92)
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	31.03.2021	IE00BKP80536	-	26,80	(23,11)
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	06.04.2021	IE00BMG4Q459	-	22,00	(19,26)
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	06.04.2021	IE00BN6JBK81	-	22,20	(18,99)
Thesaurierende Klasse USD A	02.12.2021	IE00BKPKM429	-	2,40	(28,91)
Thesaurierende Klasse USD I	24.02.2021	IE00BMQC6Y99	-	23,30	(28,39)
Ausschüttende Klasse USD I	24.02.2021	IE00BMQC7139	-	23,30	(28,30)
Thesaurierende Klasse USD M	15.03.2021	IE00BKPKM312	-	21,00	(29,42)
Thesaurierende Klasse USD Z	25.02.2022	IE00BASSUZ5	-	-	(16,80)

## High Yield Bond

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	05.09.2012	IE00B7VR8263	2,53	3,57	(13,52)
Thesaurierende Klasse AUD A	28.08.2012	IE00B5NTQ667	2,67	3,51	(13,50)
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	22.07.2013	IE00B9276P83	0,98	1,72	(14,90)
Thesaurierende Klasse AUD B	10.12.2020	IE00B8HXFL36	0,60	1,79	(14,94)
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	19.07.2013	IE00B9276Q90	0,99	1,73	(14,87)
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	02.07.2014	IE00BNJZT320	0,88	1,92	(14,86)
Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNJZT213	0,98	1,85	(14,90)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Ausschüttende Klasse AUD I	29.12.2011	IE00B52MT459	3,25	4,11	(13,01)
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	27.06.2013	IE00B9276R08	1,92	2,93	(14,09)
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	11.06.2013	IE00B95QHL52	1,97	2,90	(14,08)
Thesaurierende Klasse AUD T	02.08.2013	IE00B8HXFR97	1,98	2,84	(13,96)
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	23.07.2013	IE00B8HXG658	3,44	3,62	(12,76)
Thesaurierende Klasse CHF A	05.07.2011	IE00B5YDJD53	2,18	2,75	(14,78)
Thesaurierende Klasse CHF I	27.05.2011	IE00B53JGK04	2,76	3,41	(14,25)
Ausschüttende Klasse CHF I	07.05.2013	IE00B4QWB156	2,71	-	-
Thesaurierende Klasse CHF I2	22.10.2013	IE00BCDYX925	2,88	3,48	(14,18)
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	01.08.2012	IE00B7YPR088	5,51	6,52	(11,77)
Ausschüttende Klasse CNY A (Wöchentlich)	10.01.2013	IE00B7X4QQ52	5,55	-	-
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	09.11.2012	IE00B841H259	6,15	7,15	(11,23)
Ausschüttende Klasse CNY T (Monatlich)	14.04.2014	IE00BK4YYC75	4,84	-	-
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	19.06.2012	IE00B4024J04	2,37	3,04	(14,81)
Thesaurierende Klasse EUR A	03.05.2006	IE00B12VWB25	2,44	2,95	(14,76)
Ausschüttende Klasse EUR A	24.02.2012	IE00B718SL89	2,46	2,95	(14,73)
Thesaurierende Klasse EUR I	09.11.2009	IE00B12VW904	3,03	3,65	(14,30)
Ausschüttende Klasse EUR I	18.10.2012	IE00B8FFFY43	3,00	3,64	(14,32)
Thesaurierende Klasse EUR I2	05.12.2012	IE00B86LQM64	3,21	3,65	(14,18)
Ausschüttende Klasse EUR I2	05.12.2012	IE00B6TSGI97	2,96	3,72	(14,23)
Thesaurierende Klasse EUR I5	09.01.2020	IE00BKKL6930	3,10	3,98	-
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00B5S7G446	1,79	2,43	(15,29)
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00B5S7G552	1,80	-	-
Thesaurierende Klasse EUR Z	05.11.2014	IE00BKJ95L31	3,69	4,22	(13,73)
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	07.07.2014	IE00BCDYX818	2,39	3,60	(13,21)
Thesaurierende Klasse GBP A	27.04.2011	IE00B1G9WD45	2,43	3,62	(13,18)
Ausschüttende Klasse GBP A	24.02.2012	IE00B1G9WG75	2,51	3,66	(13,27)
Thesaurierende Klasse GBP I	27.07.2010	IE00B1G9WC38	3,06	4,25	(12,69)
Ausschüttende Klasse GBP I	08.11.2006	IE00B1G9WJ07	3,10	4,32	(12,72)
Thesaurierende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B76HSR65	3,16	4,31	(12,60)
Ausschüttende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B8KDTL88	3,17	4,24	(12,59)
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BKJ95N54	3,73	4,89	(12,10)
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	14.09.2012	IE00B87ZP976	4,66	3,85	(12,84)
Thesaurierende Klasse HKD A	19.09.2012	IE00B8G0M149	4,67	-	-
Thesaurierende Klasse SEK A	16.06.2011	IE00B5N0GF80	2,41	3,36	(14,24)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	30.03.2012	IE00B513D147	3,46	3,82	(12,73)
Thesaurierende Klasse SGD A	09.03.2012	IE00B3VJ3Q31	3,46	3,82	(12,74)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	02.05.2012	IE00B4KRFX62	4,50	3,84	(12,45)
Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	22.01.2013	IE00B88XV589	4,51	3,85	(12,35)
Thesaurierende Klasse USD A	11.01.2010	IE00B12VW672	4,55	3,85	(12,40)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Ausschüttende Klasse USD A	24.02.2012	IE00B1G9WM36	4,48	3,90	(12,37)
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	31.10.2012	IE00B9276S15	2,88	2,23	(13,86)
Thesaurierende Klasse USD B	31.10.2012	IE00B9276M52	2,83	2,19	(13,72)
Thesaurierende Klasse USD C	21.11.2012	IE00B8JXNK68	3,87	3,20	(12,91)
Ausschüttende Klasse USD C	21.11.2012	IE00B76CC794	3,91	-	-
Thesaurierende Klasse USD C1	25.10.2017	IE00B8521692	3,47	2,90	(13,29)
Ausschüttende Klasse USD C1	07.09.2017	IE00BF2DC164	3,49	2,76	(13,20)
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	31.10.2012	IE00B9276T22	2,88	2,23	(13,86)
Thesaurierende Klasse USD C2	31.10.2012	IE00B9276N69	2,83	2,27	(13,78)
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	02.07.2014	IE00BLDYHX78	2,80	2,15	(13,73)
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNJZJ94	2,87	2,25	(13,80)
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	13.09.2012	IE00B6VF0729	5,13	4,39	(11,86)
Thesaurierende Klasse USD I	03.05.2006	IE00B12VW565	5,13	4,51	(11,84)
Ausschüttende Klasse USD I	16.11.2006	IE00B1G9WK12	5,14	4,57	(11,90)
Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	24.09.2015	IE00BH2RDM00	5,24	4,69	(11,82)
Thesaurierende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8QB01	5,24	4,64	(11,74)
Ausschüttende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8BBXZ30	5,23	4,61	(11,79)
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	01.06.2016	IE00BYX24752	5,42	4,75	(11,71)
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHR30	3,93	3,26	(12,93)
Ausschüttende Klasse USD M	01.03.2018	IE00BDFBKN13	3,94	3,24	(12,84)
Thesaurierende Klasse USD P	09.01.2018	IE00BTKH9V70	5,18	4,49	(11,82)
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31.10.2012	IE00B9276V44	3,73	3,31	(12,92)
Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	11.06.2013	IE00B8B5Y742	3,97	3,17	(12,83)
Thesaurierende Klasse USD T	31.10.2012	IE00B9276L46	3,89	3,22	(12,90)
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	02.05.2013	IE00B7Y5Q239	4,69	4,28	(12,17)
Thesaurierende Klasse USD U	09.10.2012	IE00B84LT637	4,87	4,22	(12,16)
Thesaurierende Klasse USD Z	02.05.2014	IE00BKJ9LT35	5,77	5,08	(11,29)
Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich)	05.11.2013	IE00BCZTFM26	7,52	-	-
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0S16	5,79	6,98	(10,73)
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0T23	5,78	6,98	(10,72)
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	02.07.2014	IE00BLDYHZ92	5,78	6,98	(10,73)
Thesaurierende Klasse ZAR E	02.07.2014	IE00BNJZT544	5,84	6,99	(10,73)
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0V45	6,85	8,05	(9,83)
Thesaurierende Klasse ZAR T	19.12.2016	IE00BCDYXM56	6,92	8,06	(9,83)
<b>InnovAsia 5G<sup>2</sup></b>					
Thesaurierende Klasse CHF I4	14.07.2021	IE000R62XXS0	-	8,60	(41,16)
Thesaurierende Klasse EUR A	14.07.2021	IE00051SPWY7	-	8,20	(41,59)
Thesaurierende Klasse EUR I4	14.07.2021	IE0001S98TH9	-	8,80	(40,99)
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	18.10.2021	IE0005LXGGN3	-	19,40	(36,52)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### InnovAsia 5G<sup>2</sup> (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse EUR X	14.07.2021	IE000GVZECQ2	-	8,30	(41,55)
Thesaurierende Klasse SGD A	14.07.2021	IE0004VBKI06	-	8,75	(40,37)
Thesaurierende Klasse SGD I4	14.07.2021	IE000FO9NFS0	-	9,40	(39,67)
Thesaurierende Klasse SGD X	14.07.2021	IE0004JUGJ61	-	8,90	(40,22)
Thesaurierende Klasse USD A	14.07.2021	IE00049QBO88	-	9,00	(39,91)
Thesaurierende Klasse USD I	14.07.2021	IE000J2D2XC9	-	9,50	(39,36)
Thesaurierende Klasse USD I4	14.07.2021	IE0002MSVLE6	-	9,70	(39,20)
Thesaurierende Klasse USD M	05.11.2021	IE0005QTSW89	-	5,10	(40,44)
Thesaurierende Klasse USD X	14.07.2021	IE0007HVSKH0	-	9,20	(39,74)

#### Japan Equity Engagement

Ausschüttende Klasse EUR I5	10.02.2022	IE0000I94UW8	-	-	(5,40)
Thesaurierende Klasse GBP I5	22.09.2021	IE000OR9P9C5	-	(6,60)	(12,96)
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	11.11.2021	IE0002CL69U2	-	(6,10)	(15,97)
Thesaurierende Klasse JPY I	12.05.2020	IE00BLXGR37	48,43	13,83	(14,18)
Ausschüttende Klasse JPY I	12.05.2020	IE00BLXGS44	48,43	13,83	(14,18)
Thesaurierende Klasse JPY I5	16.02.2021	IE00BL5B4J15	-	8,84	(13,81)
Thesaurierende Klasse JPY Z	28.04.2021	IE00BMDOC484	-	6,57	(13,44)

#### Macro Opportunities FX

Thesaurierende Klasse EUR I	04.12.2019	IE00BK70Z635	(3,10)	(2,37)	(2,53)
Thesaurierende Klasse EUR M	04.05.2020	IE00BK527S75	0,30	(3,49)	-
Thesaurierende Klasse GBP Z	04.12.2019	IE00BGOWMX45	(1,80)	(1,12)	(0,21)
Thesaurierende Klasse SEK I	11.12.2019	IE00BK70Z742	(2,64)	(1,93)	(1,94)
Ausschüttende Klasse SEK I	20.10.2021	IE00BL1GVW28	(2,64)	(1,23)	(1,83)
Thesaurierende Klasse USD I	04.12.2019	IE00BK70Z528	(1,60)	(1,62)	(0,51)
Thesaurierende Klasse USD X	04.12.2019	IE00BK96H638	(1,20)	(1,11)	-
Thesaurierende Klasse USD Z	04.12.2019	IE00BK70Z411	(1,00)	(0,91)	-

#### Multi-Asset Growth\*

Thesaurierende Klasse EUR M	19.10.2018	IE00BFZ8B003	4,58	-	-
Thesaurierende Klasse GBP I	31.05.2019	IE00BHR06707	4,80	-	-
Thesaurierende Klasse USD I	22.12.2017	IE00BYWRVS11	9,48	-	-
Ausschüttende Klasse USD I	22.12.2017	IE00BYWSNW22	9,48	-	-

\* Das Portfolio wurde am 7. Mai 2020 aufgelöst.

#### Multi-Asset Income

Ausschüttende Klasse EUR A	30.12.2019	IE00BL4KJV67	2,56	-	-
Thesaurierende Klasse EUR I	13.12.2019	IE00BKTC3418	3,21	6,41	-

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse EUR M	09.08.2017	IE00BYMJ8N16	1,84	-	-
Ausschüttende Klasse EUR M	09.08.2017	IE00BYX7M100	1,76	-	-
Ausschüttende Klasse GBP P	27.02.2020	IE00BKKJBN69	4,62	7,13	(12,68)
Thesaurierende Klasse USD A	28.02.2018	IE00BYW7V037	4,74	6,70	(12,47)
Thesaurierende Klasse USD C1	01.03.2018	IE00BF47NK24	3,75	5,56	(13,25)
Thesaurierende Klasse USD I	28.12.2016	IE00BYX4Q314	5,51	7,35	(11,86)
Ausschüttende Klasse USD I	28.12.2016	IE00BYX4Q421	5,45	7,30	(11,76)
Thesaurierende Klasse USD I2	08.09.2021	IE000L8RADS7	-	0,80	-
Thesaurierende Klasse USD M	09.08.2017	IE00BYMJ8K84	4,00	5,76	(13,15)

## Multi-Style Premia\*

Thesaurierende Klasse USD I	01.03.2019	IE00BF0V0639	(24,86)	-	-
Ausschüttende Klasse USD I	01.03.2019	IE00BF0V0746	(24,87)	-	-
Thesaurierende Klasse USD Z	30.10.2019	IE00BF0V0969	(24,28)	-	-

\* Das Portfolio wurde am 24. Februar 2021 aufgelöst.

## Next Generation Mobility

Thesaurierende Klasse EUR A	07.09.2018	IE00BD6J9V56	34,99	21,59	(29,83)
Thesaurierende Klasse EUR I	13.01.2021	IE00BN6HJT78	-	16,00	(29,22)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	24.06.2020	IE00BKPHW879	28,00	33,44	(21,37)
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	26.10.2018	IE00BD6JB422	26,14	31,25	(22,68)
Thesaurierende Klasse USD A	11.09.2018	IE00BD6J9T35	38,63	22,92	(26,86)
Thesaurierende Klasse USD C1	21.05.2019	IE00BHR06368	37,26	21,67	(27,53)
Thesaurierende Klasse USD I	21.08.2018	IE00BFY81J05	39,77	24,03	(26,22)
Ausschüttende Klasse USD I	21.08.2018	IE00BFLTYG40	39,77	23,98	(26,20)
Thesaurierende Klasse USD M	21.05.2019	IE00BHR06475	37,57	21,91	(27,44)
Thesaurierende Klasse USD X	23.01.2019	IE00BGQVSN72	38,83	23,14	(26,74)

Next Generation Space Economy<sup>1</sup>

Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	10.05.2022	IE000KBH8HE5	-	-	(4,90)
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	10.05.2022	IE000RHGM613	-	-	(6,10)
Thesaurierende Klasse USD I	10.05.2022	IE000PK18K22	-	-	(3,90)

## Short Duration Emerging Market Debt

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	31.08.2016	IE00BMN93860	2,47	(0,77)	(8,23)
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	06.11.2015	IE00BMN93G40	3,03	(0,61)	(7,71)
Thesaurierende Klasse CHF A	06.06.2014	IE00BDZRWQ63	1,46	(1,54)	(9,78)
Ausschüttende Klasse CHF A	06.06.2014	IE00BDZRWR70	1,52	(1,54)	(9,73)
Thesaurierende Klasse CHF I	06.06.2014	IE00BDZRWS87	1,99	(1,02)	(9,31)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Ausschüttende Klasse CHF I	13.06.2014	IE00BDZRWT94	2,04	(1,02)	(9,35)
Thesaurierende Klasse CHF I2	20.02.2015	IE00BDZRWW17	2,15	(0,91)	(9,23)
Ausschüttende Klasse CHF I2	18.04.2017	IE00BNJZW449	2,20	(0,96)	(9,17)
Thesaurierende Klasse CHF I5	31.03.2014	IE00BDZRWX31	2,30	(0,81)	(9,16)
Thesaurierende Klasse CHF P	25.04.2017	IE00BVJFOP79	2,06	(1,06)	(9,25)
Ausschüttende Klasse CHF P	14.07.2017	IE00BYVLFJ35	2,04	-	-
Thesaurierende Klasse EUR A	13.06.2014	IE00BDZRWZ54	1,81	(1,40)	(9,48)
Ausschüttende Klasse EUR A	06.06.2014	IE00BDZR078	1,82	(1,30)	(9,51)
Thesaurierende Klasse EUR I	06.06.2014	IE00BDZR185	2,41	(0,90)	(9,02)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	11.04.2019	IE00BJ7JJS33	(4,49)	-	-
Ausschüttende Klasse EUR I	06.06.2014	IE00BDZR292	2,34	(0,92)	(8,91)
Thesaurierende Klasse EUR I2	23.06.2014	IE00BDZR300	2,39	(0,72)	(8,96)
Ausschüttende Klasse EUR I2	30.03.2017	IE00BDZR417	2,46	(0,80)	(8,89)
Thesaurierende Klasse EUR I5	14.03.2014	IE00BDZR524	2,58	(0,61)	(8,83)
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB95M67	1,15	(1,99)	(9,94)
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB93N35	1,11	(1,93)	(9,94)
Thesaurierende Klasse EUR P	23.02.2017	IE00BYXJQV46	2,32	(0,85)	(9,04)
Thesaurierende Klasse EUR U	06.06.2018	IE00BNJZW555	2,13	(1,14)	(9,19)
Ausschüttende Klasse EUR X	16.03.2020	IE00BL6THB70	7,54	(0,77)	(8,92)
Thesaurierende Klasse GBP A	22.11.2016	IE00BDZR748	2,34	(0,73)	(8,00)
Thesaurierende Klasse GBP I	16.12.2016	IE00BDZR961	2,86	(0,18)	(7,54)
Ausschüttende Klasse GBP I	20.02.2018	IE00BDZR885	2,91	(0,22)	(7,54)
Thesaurierende Klasse GBP I2	30.09.2016	IE00BDZRXC92	2,96	(0,09)	(7,46)
Ausschüttende Klasse GBP I2	19.10.2017	IE00BDZR000	2,99	(0,19)	(7,43)
Ausschüttende Klasse GBP I5	11.04.2014	IE00BDZR031	3,08	0,05	(7,29)
Thesaurierende Klasse GBP P	13.08.2019	IE00BGV7J266	2,95	(0,29)	(7,46)
Ausschüttende Klasse GBP P	05.02.2021	IE00BM9TKP66	-	(0,71)	-
Thesaurierende Klasse JPY I	23.02.2015	IE00BDZR076	2,55	(0,41)	(9,09)
Ausschüttende Klasse JPY I	22.09.2014	IE00BDZR083	2,54	(0,41)	(9,09)
Thesaurierende Klasse SEK A	02.02.2018	IE00BF18PM41	2,10	(1,03)	(9,09)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BMN94165	3,12	(0,50)	(7,66)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BMN94611	3,55	(0,53)	(7,54)
Thesaurierende Klasse USD A	06.12.2013	IE00BDZR046	3,54	(0,57)	(7,53)
Ausschüttende Klasse USD A	06.06.2014	IE00BDZR052	3,53	(0,52)	(7,55)
Thesaurierende Klasse USD C1	29.08.2017	IE00BFH58D19	2,57	(1,58)	(8,47)
Ausschüttende Klasse USD C1	29.08.2017	IE00BF2DC271	2,46	(1,53)	(8,45)
Thesaurierende Klasse USD I	31.10.2013	IE00BDZR069	4,10	-	(7,09)
Ausschüttende Klasse USD I	02.06.2016	IE00BDZR098	3,96	(0,01)	(7,07)
Thesaurierende Klasse USD I2	12.09.2014	IE00BDZR013	4,19	0,08	(6,99)
Ausschüttende Klasse USD I2	30.10.2015	IE00BDZR043	4,17	0,09	(6,99)
Thesaurierende Klasse USD I5	19.03.2014	IE00BDZR066	4,31	0,23	(6,84)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Ausschüttende Klasse USD I5	09.10.2014	IE00BDZRY597	4,32	0,29	(6,87)
Thesaurierende Klasse USD M	24.08.2017	IE00BDFBKQ44	2,92	(1,10)	(8,13)
Ausschüttende Klasse USD M	29.08.2017	IE00BDFBKR50	2,89	(1,06)	(8,11)
Thesaurierende Klasse USD P	10.08.2015	IE00BTKH9Z19	4,06	-	(7,08)
Thesaurierende Klasse USD Z	01.04.2014	IE00BKKMWB06	4,59	0,46	(6,60)

## Short Duration High Yield SDG Engagement

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	11.06.2013	IE00B8DK4D30	1,39	2,94	(5,86)
Thesaurierende Klasse CHF A	09.03.2012	IE00B7FN4Q69	0,53	2,21	(7,17)
Thesaurierende Klasse CHF I	20.12.2011	IE00B7FN4P52	1,17	2,89	(6,66)
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	01.08.2012	IE00B8474M21	3,94	5,95	(4,07)
Thesaurierende Klasse EUR A	20.12.2011	IE00B7FN4G61	0,85	2,45	(6,92)
Ausschüttende Klasse EUR A	14.02.2014	IE00B51MHK83	0,79	2,54	(7,02)
Thesaurierende Klasse EUR I	20.12.2011	IE00B7FN4F54	1,46	3,05	(6,38)
Thesaurierende Klasse EUR I2	05.12.2012	IE00B83NML60	1,50	3,21	(6,30)
Ausschüttende Klasse EUR I2	05.12.2012	IE00B87KSN79	1,60	-	-
Ausschüttende Klasse EUR I3	30.03.2017	IE00B76LTP37	1,66	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB93P58	0,28	1,79	(7,49)
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB93Q65	0,23	1,84	(7,54)
Thesaurierende Klasse GBP I	17.01.2012	IE00B7FN4H78	1,75	3,66	(4,91)
Ausschüttende Klasse GBP I	20.12.2011	IE00B7FN4M22	1,74	3,76	(5,06)
Thesaurierende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B87CZ321	1,89	3,79	(4,82)
Ausschüttende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B7NK7601	1,76	3,85	(4,88)
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	21.09.2022	IE0000C39ZN4	-	-	0,93
Thesaurierende Klasse JPY I	28.03.2012	IE00B7FN4K08	1,67	3,53	(6,41)
Ausschüttende Klasse JPY I	19.10.2022	IE00BF0BZ353	-	-	1,47
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	17.01.2014	IE00B6RMD591	1,93	3,29	(5,08)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	22.01.2014	IE00B7FN5305	2,73	3,33	(4,73)
Thesaurierende Klasse USD A	20.12.2011	IE00B7FN4D31	2,78	3,30	(4,79)
Ausschüttende Klasse USD A	30.11.2012	IE00B7FN5073	2,79	3,32	(4,83)
Thesaurierende Klasse USD C	21.11.2012	IE00B8DP2F62	2,13	-	-
Ausschüttende Klasse USD C	21.11.2012	IE00B7KQ7V62	2,26	-	-
Thesaurierende Klasse USD C1	02.10.2017	IE00BDFBKS67	1,82	2,25	(5,79)
Thesaurierende Klasse USD I	20.12.2011	IE00B7FN4C24	3,46	3,91	(4,18)
Ausschüttende Klasse USD I	09.01.2012	IE00B7FN4Z50	3,45	3,84	(4,15)
Thesaurierende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8110967	3,54	4,03	(4,17)
Ausschüttende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8K3ZX25	3,52	4,04	(4,15)
Thesaurierende Klasse USD I5	08.09.2022	IE000QHA8X05	-	-	0,40
Thesaurierende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BDFBKT74	2,16	2,67	(5,38)
Ausschüttende Klasse USD M	20.12.2017	IE00BDFBKV96	2,14	2,61	(5,37)



## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse USD Z	01.04.2014	IE00BKJ9TG65	4,06	4,54	(3,66)

#### Strategic Income

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJFZ213	5,94	1,85	(11,58)
Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	01.07.2019	IE00BH3W6Z85	6,99	2,88	(10,76)
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	07.08.2017	IE00BQR9PJ58	5,69	1,18	(12,73)
Thesaurierende Klasse EUR A	04.02.2016	IE00BQR9PH35	5,62	-	-
Thesaurierende Klasse EUR A	14.11.2022	IE0004VYIY29	-	-	0,50
Thesaurierende Klasse EUR I	22.01.2016	IE00B9154717	6,21	1,75	(12,32)
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB97642	4,93	0,71	(13,29)
Ausschüttende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BWB97758	5,02	-	-
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJFZD22	5,75	1,91	(11,37)
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJFZH69	7,66	2,10	(11,15)
Thesaurierende Klasse JPY I	26.04.2013	IE00B9F63958	6,13	2,27	(12,44)
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	26.04.2013	IE00B9C7XK23	2,67	14,52	2,90
Ausschüttende Klasse JPY I CG	10.08.2015	IE00BYZFYQ11	6,13	2,27	(12,44)
Ausschüttende Klasse JPY I	25.06.2014	IE00BNCBRC28	6,13	2,27	(12,44)
Thesaurierende Klasse JPY Z	01.04.2022	IE000U3RQHX4	-	-	(8,46)
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BRJFZM13	6,62	2,17	(10,99)
Thesaurierende Klasse SGD A	15.09.2017	IE00BQSBQV90	6,67	2,10	(10,94)
Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	04.06.2018	IE00BDFDPD26	7,12	2,64	(10,48)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B7BTH691	7,55	2,14	(10,63)
Thesaurierende Klasse USD A	11.02.2015	IE00B87L2R26	7,51	2,17	(10,61)
Ausschüttende Klasse USD A	10.08.2016	IE00BD0PCD21	7,53	2,14	(10,62)
Thesaurierende Klasse USD C1	25.08.2017	IE00BDFBLQ19	6,48	1,07	(11,51)
Thesaurierende Klasse USD I	26.04.2013	IE00B8HX1V50	8,04	2,70	(10,24)
Ausschüttende Klasse USD I	10.12.2014	IE00B9DN9Q73	8,15	2,65	(10,19)
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHS47	6,88	1,59	(11,18)
Ausschüttende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BDFBLR26	6,84	1,55	(11,16)
Thesaurierende Klasse USD Z	30.06.2014	IE00BKMMVY67	8,57	3,16	(9,69)

#### Sustainable Asia High Yield<sup>2</sup>

Thesaurierende Klasse EUR X	28.01.2022	IE0009LNQCG8	-	-	(14,90)
Thesaurierende Klasse GBP X	08.04.2022	IE0002USV3J1	-	-	(6,90)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	13.12.2021	IE0003AW7W04	-	(1,00)	(16,64)
Thesaurierende Klasse USD A	13.12.2021	IE000198A7B6	-	(1,00)	(16,36)
Thesaurierende Klasse USD I	13.12.2021	IE000RBQOOF7	-	(1,00)	(15,76)
Thesaurierende Klasse USD Z	21.01.2022	IE000I87JBO0	-	-	(13,43)
Ausschüttende Klasse USD Z	22.03.2022	IE000HTH7XL4	-	-	(2,84)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse CHF A	28.06.2013	IE00B97C6B44	2,70	-	-
Thesaurierende Klasse CHF I	28.06.2013	IE00B97C6C50	3,50	(1,84)	(14,24)
Thesaurierende Klasse CHF I2	25.03.2015	IE00BLDYJP35	3,68	-	-
Thesaurierende Klasse CHF I4	05.11.2019	IE00BK70Z858	3,86	(1,53)	(13,94)
Thesaurierende Klasse CHF I5	12.06.2014	IE00BLDYJR58	3,87	-	-
Thesaurierende Klasse EUR A	17.12.2015	IE00B984JD20	2,93	(2,51)	(14,60)
Thesaurierende Klasse EUR I	28.06.2013	IE00B984JG50	3,77	(1,63)	(13,94)
Ausschüttende Klasse EUR I	05.12.2014	IE00B984JQ58	3,88	-	-
Thesaurierende Klasse EUR I3	29.07.2016	IE00BD3H7L85	4,19	(1,40)	(13,64)
Thesaurierende Klasse EUR I5	11.06.2014	IE00BCFFV337	4,16	-	-
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BWB97F31	2,20	(3,19)	(15,32)
Ausschüttende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BWB97G48	2,13	(3,20)	(15,23)
Thesaurierende Klasse EUR X	20.07.2015	IE00BXDZNR08	4,21	(1,15)	(13,59)
Thesaurierende Klasse GBP I	28.06.2013	IE00B984KJ54	4,24	(0,98)	(12,60)
Thesaurierende Klasse SEK A	01.02.2018	IE00BYMJ8H55	2,92	(2,06)	(14,29)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B984MC26	4,81	(1,57)	(12,64)
Thesaurierende Klasse USD A	28.06.2013	IE00B984MH70	4,86	(1,54)	(12,76)
Thesaurierende Klasse USD C1	29.08.2017	IE00BDFBJC35	3,84	(2,53)	(13,70)
Thesaurierende Klasse USD I	28.06.2013	IE00B984QG44	5,66	(0,73)	(12,06)
Ausschüttende Klasse USD I	28.06.2013	IE00B984QK89	5,59	(0,77)	(12,07)
Thesaurierende Klasse USD I2	25.03.2015	IE00B984N180	5,82	(0,66)	(11,89)
Thesaurierende Klasse USD I5	11.06.2014	IE00BCFFV006	6,14	(0,43)	(11,68)
Thesaurierende Klasse USD M	03.10.2017	IE00BDFBJD42	4,03	(2,43)	(13,39)
Ausschüttende Klasse USD M	03.11.2017	IE00BDFBJF65	4,01	(2,34)	(13,41)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency<sup>1</sup>

Thesaurierende Klasse EUR I3	26.09.2022	IE000I1CMUN9	-	-	7,90
Thesaurierende Klasse EUR I5	08.03.2022	IE000WNKM6C0	-	-	0,10
Thesaurierende Klasse EUR X	19.01.2022	IE000ROI8ND2	-	-	(16,40)
Thesaurierende Klasse USD I	19.01.2022	IE000FZALWJ6	-	-	(14,60)
Thesaurierende Klasse USD I5	27.01.2022	IE0007IY0WW3	-	-	(14,50)

## Systematic Global Sustainable Value

Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BYNBZH92	9,19	17,25	(16,84)
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	27.09.2022	IE0007DELM88	-	-	0,80
Thesaurierende Klasse USD A	14.08.2017	IE00BSNM7G36	13,01	19,42	(13,31)
Thesaurierende Klasse USD I	18.12.2014	IE00BSNM7J66	13,73	20,01	(12,92)
Thesaurierende Klasse USD I3	31.05.2022	IE0006B0IPZ0	-	-	(5,30)
Thesaurierende Klasse USD Z	24.05.2016	IE00BSNM7Q34	14,45	20,71	(12,53)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Ultra Short Term Euro Bond

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse CHF P	30.05.2022	IE000BN78WH6	-	-	(2,52)
Thesaurierende Klasse CHF U	17.12.2019	IE00BL1GVV11	2,26	0,66	(5,84)
Thesaurierende Klasse EUR A	10.06.2021	IE00BNG2T811	-	(0,17)	(5,75)
Thesaurierende Klasse EUR I	31.10.2018	IE00BFZMJT78	2,50	1,04	(5,59)
Ausschüttende Klasse EUR I	31.10.2018	IE00BFZMJS61	2,51	1,03	(5,58)
Thesaurierende Klasse EUR I2	27.02.2020	IE00BKLC3S38	2,68	1,07	(5,55)
Thesaurierende Klasse EUR I5	06.02.2019	IE00BHR3GK28	2,62	1,12	(5,49)
Thesaurierende Klasse EUR M	29.07.2021	IE000XRSHD49	-	(0,50)	(6,31)
Thesaurierende Klasse EUR U	17.12.2019	IE00BL1GVT98	2,41	0,94	(5,68)
Thesaurierende Klasse EUR Z	20.12.2018	IE00BH453S87	2,71	1,21	(5,38)
Thesaurierende Klasse USD I	15.09.2021	IE000WMR7CB5	-	(0,05)	(3,62)
Thesaurierende Klasse USD M	05.08.2019	IE00BJ7WS967	3,34	-	-
Thesaurierende Klasse USD Z	24.01.2019	IE00BH453T94	4,36	2,01	(3,43)

#### Uncorrelated Strategies

Thesaurierende Klasse CHF I	13.03.2018	IE00BF2F4M73	3,35	(1,62)	6,38
Thesaurierende Klasse CHF I5	08.09.2017	IE00BZ3CG211	3,66	(1,37)	6,87
Thesaurierende Klasse EUR A	20.08.2018	IE00BDC3ND11	2,85	(2,16)	5,78
Thesaurierende Klasse EUR I	06.03.2018	IE00BF2F4L66	3,62	(1,50)	6,59
Thesaurierende Klasse EUR I2	06.07.2017	IE00BD5BKL97	3,73	(1,36)	6,79
Thesaurierende Klasse EUR I5	31.05.2017	IE00BF076079	4,00	(1,15)	7,00
Thesaurierende Klasse EUR M	15.09.2017	IE00BDC3NF35	2,01	(3,00)	4,91
Thesaurierende Klasse EUR P	05.07.2022	IE00093NGSP5	-	-	(1,50)
Thesaurierende Klasse GBP I	30.06.2017	IE00BF47M490	4,59	(0,84)	8,58
Thesaurierende Klasse GBP I2	06.07.2017	IE00BD5BKG45	4,79	(0,75)	8,75
Ausschüttende Klasse GBP I2	30.08.2022	IE000R82ESQ2	-	-	(0,40)
Thesaurierende Klasse GBP I5	31.05.2017	IE00BF076186	5,04	(0,55)	9,01
Thesaurierende Klasse GBP P	02.10.2018	IE00BFXBF434	4,65	(0,87)	8,67
Thesaurierende Klasse GBP Z	29.06.2017	IE00BYQDD455	5,36	(0,18)	9,47
Thesaurierende Klasse JPY I	01.04.2022	IE00BYQDD349	-	-	2,99
Thesaurierende Klasse SGD A	06.11.2018	IE00BGR6TZ09	3,86	-	0,55
Thesaurierende Klasse USD A	26.01.2018	IE00BF076L85	4,31	(1,44)	7,50
Thesaurierende Klasse USD C1	06.03.2018	IE00BYW7V144	3,25	(2,46)	6,55
Thesaurierende Klasse USD I	31.05.2017	IE00BF075X33	5,10	(0,72)	8,33
Thesaurierende Klasse USD I2	06.07.2017	IE00BD5BKM05	5,29	(0,63)	8,49
Thesaurierende Klasse USD I5	31.05.2017	IE00BF07FG69	5,52	(0,35)	8,72
Thesaurierende Klasse USD M	09.08.2017	IE00BZ3CG328	3,47	(2,20)	6,66
Thesaurierende Klasse USD P	12.12.2018	IE00BFZPTC98	5,15	(0,65)	8,36
Thesaurierende Klasse USD Z	08.09.2017	IE00BF23SS52	5,92	-	9,22

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

XXXXXXXXXXXX<sup>1</sup>

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse EUR X	14.06.2022	IE000L1JDD81	-	-	(1,70)
Thesaurierende Klasse USD X	22.06.2022	IE0003VEJ409	-	-	0,00
<b>US Equity</b>					
Thesaurierende Klasse JPY I3	01.03.2022	IE000XSV3WB9	-	-	(18,40)
Thesaurierende Klasse USD A	27.03.2020	IE00BHR06814	55,30	20,67	(26,57)
Thesaurierende Klasse USD I	18.12.2015	IE00BD34ZN73	30,54	21,58	(26,01)
Ausschüttende Klasse USD I	18.12.2015	IE00BD350682	30,53	21,57	(26,03)
Thesaurierende Klasse USD M	09.02.2022	IE00BHR06B44	-	-	(22,60)
<b>US Equity Index PutWrite</b>					
Thesaurierende Klasse EUR I	13.02.2017	IE00BYX7LW42	6,40	17,26	(13,09)
Ausschüttende Klasse EUR I3	03.12.2021	IE000NHZGVS8	-	3,80	(12,93)
Thesaurierende Klasse EUR I4	28.04.2017	IE00BD4H0968	6,56	17,59	(12,86)
Thesaurierende Klasse EUR M	13.02.2017	IE00BYX7LX58	4,93	15,76	(14,33)
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	02.03.2017	IE00BYWPKN37	5,51	19,47	0,59
Thesaurierende Klasse GBP I3	11.05.2021	IE00BMWPYK46	-	14,90	0,78
Ausschüttende Klasse GBP I3	03.12.2021	IE00BMD7ZC88	-	3,71	(11,73)
Thesaurierende Klasse GBP I4	28.04.2017	IE00BD4H0851	6,92	18,06	-
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	25.10.2017	IE00BYXH8345	5,82	19,78	0,86
Ausschüttende Klasse GBP I4	05.05.2017	IE00BD3DV701	6,86	18,21	-
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	25.08.2021	IE000EORQCL4	-	5,06	0,64
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	15.08.2017	IE00BDRKGH20	5,42	17,51	(11,67)
Thesaurierende Klasse USD A	23.01.2017	IE00BDDWGC76	8,31	17,51	(11,16)
Thesaurierende Klasse USD C1	18.12.2017	IE00BDFBKW04	7,22	-	-
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	18.05.2017	IE00BD461232	8,91	18,32	(10,66)
Thesaurierende Klasse USD I	30.12.2016	IE00BDDWG831	8,91	18,36	(10,63)
Thesaurierende Klasse USD I3	24.08.2018	IE00BYXH8121	9,11	18,43	-
Ausschüttende Klasse USD I3	03.12.2021	IE000VHERIO9	-	3,90	(10,45)
Thesaurierende Klasse USD I4	28.04.2017	IE00BD4H0B82	9,16	18,63	(10,44)
Thesaurierende Klasse USD M	13.02.2017	IE00BYX7LY65	7,35	16,79	(11,87)
Thesaurierende Klasse USD P	08.10.2018	IE00BF0VOH42	9,03	-	-
Thesaurierende Klasse USD Z	10.02.2017	IE00BDDWGF08	9,56	19,15	(10,11)
<b>US Large Cap Value<sup>2</sup></b>					
Thesaurierende Klasse EUR A	19.10.2022	IE000F8FR4R1	-	-	8,70
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	21.06.2022	IE000JHJ5WY3	-	-	6,80
Thesaurierende Klasse EUR I	30.03.2022	IE000NZY26Q1	-	-	(8,00)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	19.04.2022	IE0000COXIH6	-	-	(5,80)
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	22.03.2022	IE000ALURE78	-	-	(0,90)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### US Large Cap Value<sup>2</sup> (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	27.01.2022	IE000SK5XXE9	-	-	4,20
Thesaurierende Klasse GBP I	22.11.2022	IE000I4SVYD3	-	-	(2,40)
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22.11.2022	IE00001H49K2	-	-	(3,40)
Ausschüttende Klasse GBP I	22.11.2022	IE000YZ914N6	-	-	(2,40)
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22.11.2022	IE000EA4KHA8	-	-	(3,40)
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	14.03.2022	IE0005DYIEB4	-	-	9,20
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	08.06.2022	IE0004QFE496	-	-	2,80
Ausschüttende Klasse GBP P	21.10.2022	IE000VWPWUH3	-	-	6,30
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	24.05.2022	IE000YILQ9A8	-	-	4,80
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	30.08.2022	IE000NVIOWF0	-	-	2,90
Thesaurierende Klasse USD A	24.03.2022	IE000M9KFDE8	-	-	(5,00)
Thesaurierende Klasse USD I	20.12.2021	IE0003JM1523	-	3,90	(1,06)
Ausschüttende Klasse USD I4	21.03.2022	IE000CGMU1E8	-	-	(3,70)
Thesaurierende Klasse USD I5	11.02.2022	IE000429UF11	-	-	(3,50)
Thesaurierende Klasse USD M	25.03.2022	IE000E4YYWX1	-	-	(6,50)
Thesaurierende Klasse USD Z	23.05.2022	IE0008OYN7T5	-	-	1,00

#### US Long Short Equity

Thesaurierende Klasse EUR A	06.07.2015	IE00BPRC5K89	7,69	2,73	(10,81)
Thesaurierende Klasse EUR I	01.12.2014	IE00BJTD3X67	8,58	3,74	(10,02)
Thesaurierende Klasse EUR I3	13.05.2020	IE00BMYMJT70	12,00	4,20	(9,68)
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	13.05.2020	IE00BMYMJS63	(0,10)	13,11	-
Thesaurierende Klasse EUR M	04.12.2015	IE00BWB95R13	6,70	1,95	(11,45)
Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	13.05.2020	IE00BMYMJR56	0,90	6,05	-
Ausschüttende Klasse GBP I3	08.09.2020	IE00BMXNP376	4,80	4,77	(8,20)
Thesaurierende Klasse SGD A1	31.10.2014	IE00BJTD4N35	9,00	3,89	(8,70)
Thesaurierende Klasse USD A (PF)	10.06.2015	IE00BWB95Q06	8,44	3,24	(8,01)
Thesaurierende Klasse USD A	24.02.2015	IE00BVYJ5W68	9,64	3,68	(8,56)
Thesaurierende Klasse USD A1	03.04.2014	IE00BJTD4V19	9,96	3,92	(8,28)
Thesaurierende Klasse USD C1	11.09.2017	IE00BDFBKX11	8,62	-	-
Ausschüttende Klasse USD I (PF)	13.03.2015	IE00BV9FSD10	9,04	4,07	(7,36)
Thesaurierende Klasse USD I	28.02.2014	IE00BJTCX997	10,62	4,66	(7,67)
Thesaurierende Klasse USD I3	13.05.2020	IE00BMYMKR20	12,80	5,05	(7,26)
Thesaurierende Klasse USD M	09.08.2017	IE00BZ3CG435	8,78	2,89	(9,33)
Thesaurierende Klasse USD U	06.03.2015	IE00BNJZX306	10,21	4,17	(8,15)
Thesaurierende Klasse USD Z	15.05.2014	IE00BKKN1160	12,17	6,06	(6,47)

#### US Multi Cap Opportunities

Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNK02N76	7,22	21,75	(20,80)
Thesaurierende Klasse AUD T	19.12.2016	IE00BCDZ0167	8,35	22,99	(20,01)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	21.03.2013	IE00B80TLB03	10,99	24,38	(19,56)
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB95S20	8,56	21,66	(21,32)
Thesaurierende Klasse EUR1 A	28.06.2012	IE00B7F25G09	9,70	22,90	(20,53)
Thesaurierende Klasse EUR1 I	28.06.2012	IE00B84HCB79	10,65	23,93	(19,84)
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	06.11.2017	IE00B7WF5P11	10,56	26,72	(6,27)
Thesaurierende Klasse SGD A	16.07.2013	IE00B3S45H60	10,74	23,94	(18,53)
Thesaurierende Klasse USD B	22.11.2013	IE00BCDZ0381	11,37	22,83	(18,72)
Thesaurierende Klasse USD C1	13.10.2017	IE00BDFBKF39	11,55	22,91	(18,64)
Thesaurierende Klasse USD C2	22.11.2013	IE00BCDZ0506	11,37	22,77	(18,68)
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNK02L52	11,42	22,77	(18,69)
Thesaurierende Klasse USD I3	29.04.2013	IE00B87F0588	14,05	25,64	(16,78)
Ausschüttende Klasse USD I3	30.07.2013	IE00B6W3XJ81	14,07	25,64	(16,82)
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHM84	11,54	22,91	(18,60)
Thesaurierende Klasse USD P	13.07.2018	IE00BTKHB552	13,75	-	-
Thesaurierende Klasse USD T	22.11.2013	IE00BCDZ0720	12,51	24,02	(17,85)
Thesaurierende Klasse USD U	22.01.2013	IE00B819XJ19	13,21	24,68	(17,43)
Thesaurierende Klasse USD Z	02.05.2014	IE00BKJ9MD40	14,59	26,28	(16,38)
Thesaurierende Klasse USD1 A	29.06.2012	IE00B775SV38	12,71	24,15	(17,80)
Thesaurierende Klasse USD1 I	28.06.2012	IE00B7XCGB41	13,67	25,19	(17,11)
Ausschüttende Klasse USD1 I	29.06.2012	IE00B3RSF130	13,65	25,22	(17,10)
Thesaurierende Klasse ZAR B	13.01.2014	IE00BH2RDW08	11,62	28,11	(16,64)
Thesaurierende Klasse ZAR C2	13.01.2014	IE00BH2RDX15	11,62	28,11	(16,63)
Thesaurierende Klasse ZAR E	02.07.2014	IE00BNK02M69	11,62	28,11	(16,64)
Thesaurierende Klasse ZAR T	13.01.2014	IE00BH2RDY22	12,75	29,39	(15,80)

## US Real Estate Securities

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	08.08.2016	IE00BD0PCG51	(7,73)	39,36	(30,39)
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	16.08.2016	IE00B95Z2Z11	(9,01)	37,59	(31,29)
Thesaurierende Klasse AUD B	19.08.2015	IE00B8HXG989	(8,90)	37,57	(31,29)
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	16.08.2016	IE00B95S5V74	(8,80)	37,39	(31,26)
Thesaurierende Klasse AUD C2	25.09.2015	IE00B8HXGC10	(8,82)	37,51	-
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	16.08.2016	IE00BYN4NT64	(8,93)	37,62	(31,32)
Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNK02P90	(8,80)	37,51	(31,30)
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	13.10.2015	IE00B961PR15	(8,02)	38,93	(30,59)
Thesaurierende Klasse AUD T	16.07.2013	IE00B8HXGG57	(7,97)	38,93	(30,58)
Thesaurierende Klasse CHF A	11.10.2012	IE00B68CYF25	(6,68)	38,51	(31,16)
Thesaurierende Klasse EUR A	01.02.2006	IE00B0T0GT17	(6,63)	39,11	(30,97)
Thesaurierende Klasse EUR I	01.02.2006	IE00B0T0GS00	(5,88)	39,94	(30,40)
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB97865	(7,51)	37,43	(31,56)
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	28.07.2016	IE00BD0PCF45	(3,85)	40,05	(28,92)

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse SGD A	28.05.2013	IE00B45NX917	(5,65)	40,03	(29,19)
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	18.11.2015	IE00B95QR487	(3,99)	40,21	(28,50)
Thesaurierende Klasse USD A	01.02.2006	IE00B0T0GQ85	(3,91)	40,22	(28,55)
Ausschüttende Klasse USD A	21.03.2012	IE00B1G9WX41	(3,94)	40,18	(28,53)
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	15.08.2016	IE00B95SNQ81	(5,24)	38,34	(29,45)
Thesaurierende Klasse USD B	16.07.2013	IE00B8HXHJ53	(5,15)	38,38	(29,46)
Thesaurierende Klasse USD C1	31.08.2017	IE00BDFBLK56	(4,90)	38,86	(29,25)
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	16.08.2016	IE00B95TPW15	(5,23)	38,50	(29,43)
Thesaurierende Klasse USD C2	16.07.2013	IE00B8HXHK68	(5,15)	38,41	(29,48)
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	15.08.2016	IE00BYN4NV86	(5,24)	38,34	(29,45)
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNK02Q08	(5,14)	38,40	(29,45)
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	19.11.2019	IE00B95SJP96	(3,26)	41,30	(27,96)
Thesaurierende Klasse USD I	01.02.2006	IE00B0T0GP78	(3,22)	41,31	(28,01)
Ausschüttende Klasse USD I	14.02.2013	IE00B90CY062	(3,24)	41,27	(28,01)
Thesaurierende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8B20D34	(3,05)	41,53	(27,87)
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHN91	(4,84)	38,85	(29,27)
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	01.01.2016	IE00BDD1NC38	(4,27)	39,80	(28,73)
Thesaurierende Klasse USD T	16.07.2013	IE00B8HXHL75	(4,26)	39,80	(28,76)
Thesaurierende Klasse USD Z	10.02.2015	IE00BKJ9MS92	(2,45)	42,27	(27,44)
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	16.08.2016	IE00BD89KB03	(5,01)	44,13	(27,64)
Thesaurierende Klasse ZAR B	13.03.2015	IE00BCDYZB81	(4,92)	44,17	(27,67)
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	15.08.2016	IE00BD89K988	(5,01)	44,12	(27,63)
Thesaurierende Klasse ZAR C2	11.04.2019	IE00BCDYZD06	(4,92)	44,19	(27,67)
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	16.08.2016	IE00BYN4NX01	(5,01)	44,14	(27,63)
Thesaurierende Klasse ZAR E	02.07.2014	IE00BNK02R15	(4,91)	44,18	(27,67)
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0Y75	(4,06)	45,60	(26,91)
Thesaurierende Klasse ZAR T	26.07.2013	IE00BCDYZG37	(3,96)	45,63	(26,94)

#### US Small Cap

Thesaurierende Klasse AUD B	25.10.2019	IE00B8HXHQ21	18,02	14,46	(22,92)
Thesaurierende Klasse AUD C2	04.09.2018	IE00B8HXHT51	17,86	14,40	(22,93)
Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNK02S22	18,01	14,39	(22,88)
Thesaurierende Klasse AUD T	19.12.2016	IE00B8HXJ447	19,16	15,50	(22,13)
Thesaurierende Klasse EUR A	28.06.2016	IE00B44F1J46	20,41	15,49	(22,62)
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	18.09.2020	IE00B42MJZ94	17,80	25,64	(14,66)
Thesaurierende Klasse EUR I	06.08.2013	IE00B3PY8J28	21,44	16,55	(21,97)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	16.10.2017	IE00B4NQT611	14,24	26,73	(13,94)
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	24.01.2019	IE00BGSF1T43	14,53	26,88	(13,79)
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	05.05.2022	IE000NDPFUI3	-	-	(1,40)
Thesaurierende Klasse EUR M	04.02.2016	IE00BWB97H54	19,14	14,37	(23,39)

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2020 %	2021 %	2022 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	31.03.2016	IE00BKJB1D33	22,45	17,52	(21,31)
Ausschüttende Klasse JPY I	29.07.2011	IE00B4TSG157	18,37	31,36	(7,47)
Thesaurierende Klasse USD A	05.07.2011	IE00B64QTZ34	23,58	16,74	(19,92)
Ausschüttende Klasse USD A	28.11.2016	IE00BLDYK493	23,53	16,74	(19,93)
Thesaurierende Klasse USD B	16.07.2013	IE00B8HXJT91	22,16	15,51	(20,82)
Thesaurierende Klasse USD C2	16.07.2013	IE00B8HXXK635	22,12	15,49	(20,84)
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNK02T39	22,11	15,47	(20,79)
Thesaurierende Klasse USD I	01.07.2011	IE00B66ZT477	24,61	17,78	(19,25)
Ausschüttende Klasse USD I	10.12.2013	IE00BH2RF025	24,59	17,80	(19,26)
Thesaurierende Klasse USD I3	30.07.2018	IE00B8GCB135	24,91	18,06	(19,04)
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHP16	22,41	15,59	(20,67)
Thesaurierende Klasse USD T	16.07.2013	IE00B8HXXK965	23,38	16,65	(20,02)
Thesaurierende Klasse USD Z	30.08.2016	IE00BKJ9TJ96	25,61	18,81	(18,54)
Thesaurierende Klasse ZAR E	08.08.2017	IE00BNK02V50	23,28	20,30	(18,79)
Thesaurierende Klasse ZAR T	19.12.2016	IE00BH2RF918	24,51	21,51	(17,97)

## US Small Cap Intrinsic Value

Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	09.03.2021	IE00BLR75F08	-	12,40	(10,68)
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	22.10.2021	IE00HFERTZ5	-	4,00	(10,48)
Thesaurierende Klasse USD A	04.02.2016	IE00BY7S3S36	24,63	25,28	(21,29)
Thesaurierende Klasse USD I	30.04.2015	IE00BX1D4S49	25,73	26,31	(20,64)
Thesaurierende Klasse USD I2	16.03.2022	IE00E90KKM6	-	-	(15,60)
Thesaurierende Klasse USD M	27.05.2016	IE00BYQQ4L83	23,35	24,04	(22,08)

\* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

<sup>2</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.



## Anhang III

### INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT)

Messung des Marktrisikos und des Leverage unter Verwendung des Commitment- und VaR-Ansatzes

Die Portfolios streben eine Begrenzung des durch den Einsatz von Derivaten entstehenden Marktrisikos und Leverage (Hebelung) an, indem sie entweder den Commitment-Ansatz oder eine als Value-at-Risk („VaR“) bekannte komplexe Methode der Risikomessung anwenden. Der 5G Connectivity, China A-Share Equity, China Equity, CLO Income, Corporate Hybrid Bond, Emerging Markets Equity, Emerging Markets Select Equity, European High Yield Bond, European Sustainable Equity, Global Diversified Income FMP – 2024, Global Equity Megatrends, Global Flexible Credit Income, Global High Yield SDG Engagement, Global High Yield Sustainable Action, Global Investment Grade Credit, Global Real Estate Securities, Global Sustainable Equity, High Yield Bond, InnovAsia 5G, Japan Equity Engagement, Next Generation Mobility, Next Generation Space Economy, Short Duration Emerging Market Debt, Short Duration High Yield SDG Engagement, Systematic Global Sustainable Value, US Equity, US Large Cap Value, US Multi Cap Opportunities, US Real Estate Securities, US Small Cap und US Small Cap Intrinsic Value wenden den Commitment-Ansatz an. Der Commitment-Ansatz berechnet die Hebelung, indem der Marktwert des zugrunde liegenden Derivateengagements im Verhältnis zum NIW des jeweiligen Portfolios gemessen wird. Diese Hebelung wird jedoch zu keinem Zeitpunkt den NIW des Portfolios übersteigen.

Ein Portfolio kann ein „absolutes“ VaR-Modell anwenden, bei dem die Messung des VaR relativ zum Nettoinventarwert des Portfolios erfolgt, oder ein relatives VaR-Modell, bei dem die Messung des VaR im Verhältnis zu einer derivativefreien vergleichbaren Benchmark oder einem äquivalenten Portfolio erfolgt. Das von bestimmten Portfolios verwendete Modell ist in der Spalte „Marktrisiko“ in nachstehender Tabelle angegeben. Die angewandte VaR-Methode unterliegt mehreren Einschränkungen. Erstens basiert der VaR auf einem Modell für Aktienkursrenditen, das Risikofaktoren verwendet. Insoweit es dabei fehlende Risikofaktoren, fehlspezifizierte Risikofaktoren oder Risikofaktoren gibt, die nicht vorhersehbar sind, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Ferner sind die auf verschiedene Risikofaktoren zurückzuführenden Renditen nicht direkt am Markt beobachtbar und müssen anhand statistischer Techniken geschätzt werden. Insofern diese Schätzungen nicht genau sein können, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Darüber hinaus wird die Kovarianz zwischen den Risikofaktoren über einen bestimmten historischen Zeitraum geschätzt. Insofern sich der künftige Zeitraum vom historischen Zeitraum unterscheidet, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Aus diesen Gründen kann der VaR eher als relativer Risikomaßstab unter Portfolios und nicht als absoluter Risikomaßstab nützlich sein.

Für die Portfolios, die das VaR-Modell anwenden, werden mehrere Berechnungsstandards angewandt. Auf diese Berechnungsstandards wird jedoch im Risikomanagementprozess des Portfolios näher eingegangen, und sie können sich von Zeit zu Zeit im Ermessen des Managers und gemäß den Anforderungen der Zentralbank ändern.

In der nachfolgenden Tabelle ist die maximale, minimale und durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze für die jeweiligen Portfolios, die den VaR-Ansatz anwenden, für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 aufgeführt:

Portfolio	Marktrisiko	Am 31. Dezember 2022 beobachteter VaR	Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*
Asian Debt - Hard Currency	Relativer VaR	113,8 %	70,5 %	50,2 %	61,3 %
China Bond	Absoluter VaR	1,58 %	17,5 %	6,2 %	12,5 %
Commodities	Relativer VaR	95,0 %	59,4 %	45,7 %	49,5 %
Emerging Market Debt - Hard Currency	Relativer VaR	131,5 %	76,0 %	64,4 %	67,3 %
Emerging Market Debt - Local Currency	Relativer VaR	113,1 %	56,5 %	49,5 %	53,0 %
Emerging Market Debt Blend	Relativer VaR	119,2 %	61,3 %	52,4 %	57,2 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Relativer VaR	104,1 %	53,6 %	45,9 %	50,6 %
Euro Bond Absolute Return	Absoluter VaR	1,84 %	20,1 %	4,4 %	13,6 %
Euro Opportunistic Bond	Relativer VaR	90,2 %	68,7 %	41,0 %	56,5 %
Event Driven	Absoluter VaR	5,25 %	44,9 %	18,9 %	25,2 %
Global Bond	Relativer VaR	100,2 %	52,1 %	47,5 %	50,2 %
Global Flexible Credit Income	Absoluter VaR	5,36 %	32,1 %	14,5 %	25,4 %
Global Opportunistic Bond	Absoluter VaR	4,23 %	26,5 %	10,4 %	19,8 %
Macro Opportunities FX	Absoluter VaR	1,54 %	10,6 %	3,6 %	5,8 %
Multi-Asset Income	Absoluter VaR	7,0 %	44,7 %	12,5 %	27,1 %
Strategic Income	Absoluter VaR	4,85 %	24,3 %	9,9 %	17,9 %

## Anhang III (Fortsetzung)

## INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Portfolio (Fortsetzung)	Marktrisiko	Am 31. Dezember 2022 beobachteter VaR	Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*
Sustainable Asia High Yield	Relativer VaR	103,8 %	66,0 %	37,4 %	48,5 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Relativer VaR	107,2 %	64,1 %	49,6 %	57,6 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	Relativer VaR	119,4 %	70,5 %	57,5 %	63,0 %
Ultra Short Term Euro Bond	Absoluter VaR	1,8 %	24,5 %	2,9 %	11,2 %
Uncorrelated Strategies	Absoluter VaR	1,71 %	34,3 %	4,6 %	8,4 %
XXXXXXXXXXXX	Absoluter VaR	2,87 %	61,3 %	4,1 %	19,4 %
US Equity Index PutWrite	Absoluter VaR	9,76 %	96,0 %	18,1 %	41,5 %
US Long Short Equity	Absoluter VaR	6,26 %	48,8 %	13,0 %	26,5 %

\* Regulatorische VaR-Grenze für 1M 99% VAR ist 20 %. Für den relativen VaR ist 2\* der Benchmark-VaR.

Die Portfolios können in Abhängigkeit von den Marktbedingungen von Zeit zu Zeit Leverage einsetzen. Das „Leverage“ wird gemäß den Anforderungen der Zentralbank als Summe der Nennwerte der eingesetzten Derivate berechnet. Das offen gelegte Leverage-Niveau ist nicht als zusätzliches Risiko-Limit für die Portfolios vorgesehen. Auch soll das Leverage-Niveau an sich keinen Hinweis auf das Risikoprofil der Portfolios darstellen. In der nachfolgenden Tabelle ist das während des Geschäftsjahres vorhandene Leverage-Niveau für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 aufgeführt, berechnet als die Summe des absoluten Wertes der Nennwerte der eingesetzten Derivate und angegeben als Prozentsatz vom Nettoinventarwert:

Portfolio	31. Dezember 2022
Asian Debt - Hard Currency	152 %
China Bond	166 %
Commodities	213 %
Emerging Market Debt - Hard Currency	175 %
Emerging Market Debt - Local Currency	323 %
Emerging Market Debt Blend	254 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	248 %
Euro Bond Absolute Return	248 %
Euro Opportunistic Bond	190 %
Event Driven	127 %
Global Bond	282 %
Global Flexible Credit Income	216 %
Global Opportunistic Bond	522 %
Macro Opportunities FX	1138 %
Multi-Asset Income	395 %
Strategic Income	192 %
Sustainable Asia High Yield	103 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	114 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	206 %
Ultra Short Term Euro Bond	191 %
Uncorrelated Strategies	496 %
XXXXXXXXXXXX	386 %
US Equity Index PutWrite	154 %
US Long Short Equity	154 %

## Anhang IV

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT)

Die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFTR“) führt Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) wird gemäß Artikel 3(11) der SFTR definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft
- Wertpapier- oder Rohstoffentleih- oder ausleihgeschäfte
- eine Kauf- und Rückkauftransaktion oder Verkaufs- und Rückkauftransaktion oder
- ein Lombardgeschäft

Zum 31. Dezember 2022 hielten die folgenden Portfolios Total Return Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte als unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Instrumententypen:

CLO Income  
 Commodities  
 Corporate Hybrid Bond  
 Event Driven  
 Global Flexible Credit Income  
 Global High Yield SDG Engagement  
 High Yield Bond  
 Short Duration Emerging Market Debt  
 Strategic Income  
 Uncorrelated Strategies  
 XXXXXXXXXXXXX  
 US Long Short Equity

#### CLO Income

#### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	334.323	0,24

#### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### CLO Income (Fortsetzung)

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	334.323

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	320.000	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### CLO Income (Fortsetzung)

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2022 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	<b>100 %</b>

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Commodities

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	0	0,00

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Commodities (Fortsetzung)

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	0

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	(5.450.000)	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Commodities (Fortsetzung)

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Corporate Hybrid Bond

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte in umgekehrten Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag EUR	Anteil am NIW (in %)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Verbindlichkeiten	37.445.575	2,10

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die umgekehrten Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von allen umgekehrten Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag EUR
Citigroup	37.445.575

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022 gestellt wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag EUR*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Umgekehrtes Pensionsgeschäft</b>							
Citigroup	Unternehmensanleihen	18.017.986	A-	Offen	EUR	USA	OTC
Citigroup	Unternehmensanleihen	13.484.182	BBB-	Offen	EUR	USA	OTC
Citigroup	Unternehmensanleihen	14.085.000	BBB-	> 1 Jahr	EUR	USA	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022 waren offen.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### Ertrag/Kosten:

Bei umgekehrten Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den umgekehrten Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.



## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Event Driven

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	18.364	0,04

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Morgan Stanley	18.364

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2022 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 lag über 1 Jahr.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Event Driven (Fortsetzung)

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Global Flexible Credit Income

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	632.100	0,16

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	29.717
JPMorgan Chase Bank	602.383

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
JPMorgan Chase Bank	Barsicherheiten	760.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2022 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	<b>100 %</b>

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Global High Yield SDG Engagement

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	13.411	0,00

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	13.411

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2022 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Global High Yield SDG Engagement

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### High Yield Bond

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	404.963	0,02

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
JPMorgan Chase Bank	404.963

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### High Yield Bond (Fortsetzung)

#### Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
JPMorgan Chase Bank	Barsicherheiten	300.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

#### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2022 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	<b>100 %</b>

#### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Emerging Market Debt

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte in umgekehrten Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Verbindlichkeiten	1.843.240	0,04

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die umgekehrten Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von allen umgekehrten Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Citigroup	1.843.240

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022 gestellt wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Umgekehrtes Pensionsgeschäft</b>							
Citigroup	Staatsanleihen	3.781.161	D	1 Monat bis zu 3 Monaten	US\$	USA	OTC

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022 waren offen.

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### Ertrag/Kosten:

Bei umgekehrten Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den umgekehrten Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

##### Strategic Income

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	3.863.949	0,29

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.



## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Strategic Income (Fortsetzung)

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	3.863.949

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	3.390.000	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Strategic Income (Fortsetzung)

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2022 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	<b>100 %</b>

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Uncorrelated Strategies

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	3.899.449	0,12
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	1.242.422	0,04

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

#### Konzentrierte Daten (Fortsetzung)

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	55.190
JPMorgan Chase Bank	750.561
Morgan Stanley	1.688.397
UBS AG	51.068
Société Générale	2.596.655

#### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

#### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellen sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
Citibank	Barsicherheiten	(110.000)	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	OTC
BNP Paribas	Barsicherheiten	(5.000)	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	43.310.000	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	OTC
JP Morgan Chase Bank	Barsicherheiten	261.260.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC
Merrill Lynch International	Barsicherheiten	1.730.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC
Morgan Stanley & Co International	Barsicherheiten	61.180.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC
Nomura International PLC	Barsicherheiten	34.290.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

#### Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
	Société Générale	75.000.000	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	OTC
	UBS AG London	6.500.000	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 stellten sich wie folgt dar:

Fälligkeit	Betrag US\$						offene Laufzeit
	< 1 Tag	1 Tag bis zu 1 Woche	1 Woche bis zu 1 Monat	1 Monat bis zu 3 Monaten	3 Monate bis zu 1 Jahr	> 1 Jahr	
Total Return Swaps - Vermögenswerte	-	-	137.158	2.477.772	299.370	985.149	-
Total Return Swaps - Verbindlichkeiten	-	-	204.800	-	314.928	722.694	-

#### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2022 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	<b>100 %</b>

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### XXXXXXXXXXXX (Fortsetzung)

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

##### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	678.244	0,10
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	13.154	0,00

##### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	4.031
UBS AG	13.154
Société Générale	674.213

##### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### XXXXXXXXXXXX (Fortsetzung)

#### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
	Bank of America Merrill Lynch	1.420.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC
	JP Morgan Chase Bank	24.040.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC
	Nomura International PLC	10.900.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC
	Société Générale	10.080.000	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 stellten sich wie folgt dar:

Fälligkeit	Betrag US\$						offene Laufzeit
	< 1 Tag	1 Tag bis zu 1 Woche	1 Woche bis zu 1 Monat	1 Monat bis zu 3 Monaten	3 Monate bis zu 1 Jahr	> 1 Jahr	
Total Return Swaps - Vermögenswerte	-	-	27.551	650.693	-	-	-
Total Return Swaps - Verbindlichkeiten	-	-	-	-	13.154	-	-

#### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### XXXXXXXXXXXX (Fortsetzung)

#### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### US Long Short Equity

#### Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2022 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US\$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	664.406	0,30
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	700.901	0,32

#### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

#### Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US\$
Goldman Sachs International	529.043
JPMorgan Chase Bank	836.264

#### Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### US Long Short Equity (Fortsetzung)

##### Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US\$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
<b>Total Return Swaps</b>							
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	980.000	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	OTC
JP Morgan Chase Bank	Barsicherheiten	9.500.000	k. A.	k. A.	USD	USA	OTC

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2021 stellten sich wie folgt dar:

Fälligkeit	Betrag US\$						offene Laufzeit
	< 1 Tag	1 Tag bis zu 1 Woche	1 Woche bis zu 1 Monat	1 Monat bis zu 3 Monaten	3 Monate bis zu 1 Jahr	> 1 Jahr	
Total Return Swaps - Vermögenswerte	-	-	-	-	664.406	-	-
Total Return Swaps - Verbindlichkeiten	-	-	-	-	481.544	219.357	-



## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### US Long Short Equity (Fortsetzung)

##### Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2022 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	<b>100 %</b>

##### Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Zum 31. Dezember 2022 war keines der Portfolios an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 schlossen der Corporate Hybrid Bond, Emerging Market Corporate Debt, Emerging Market Debt - Hard Currency, der Emerging Market Debt Blend, Emerging Markets Equity, der Emerging Markets Sustainable Equity, der Euro Bond Absolute Return, der European High Yield Bond, der Global Bond, Global High Yield SDG Engagement, der Global Opportunistic Bond, der High Yield Bond, der Short Duration Emerging Market Debt, der Short Duration High Yield Bond, der Strategic Income, der Systematic Global Sustainable Value, der Ultra Short Term Euro Bond, der US Equity und der US Long Short Equity Wertpapierleihgeschäfte ab, hatten zum 31. Dezember 2022 aber keine Wertpapiere verliehen.

## Anhang V

### ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT)

Die Richtlinie der Europäischen Union 2014/91/EU (die „OGAW-V Richtlinie“) trat am 18. März 2016 in Kraft. Der Fonds hat eine Vergütungspolitik eingeführt, um den Anforderungen der OGAW-V-Richtlinie und der ESMA-Leitlinien für solide Vergütungspolitiken gemäß der OGAW-V-Richtlinie in einer Form und in dem Umfang zu entsprechen, wie es der Größe des Fonds, seiner internen Organisation und der Art, dem Gegenstand und der Komplexität seiner Aktivitäten angemessen ist.

Die Vergütungspolitik des Fonds gilt für identifizierte Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben.

Zum 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine Mitarbeiter, und die Vergütungspolitik des Fonds gilt nur für Mitglieder des Direktoriums des Fonds, die den Fonds verwalten und kontrollieren. Nähere Angaben zu den Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

## Anhang VI

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)

<b>Bloomberg Commodity Index</b>	Der Index ist ein rollierender Index, der sich aus börsengehandelten Futures-Kontrakten auf physische Rohstoffe zusammensetzt. Der Index verlässt sich bei der Bestimmung der relativen Mengen der aufgenommenen Rohstoffe vor allem auf Liquiditätsdaten von Futureskontrakten sowie auf USD-bereinigte Produktionsdaten. Der Index soll eine hoch liquide und diversifizierte Benchmark für Rohstoffanlagen sein. Die Indexversion, die auf Basis der Gesamttrendite berechnet wird, spiegelt die Renditen auf eine voll besicherte Anlage in den zugrunde liegenden Rohstoff-Futureskontrakten wider, kombiniert mit den Renditen auf in US Treasury Bills investierten Barsicherheiten.
<b>Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (Total Return, abgesichert, EUR)</b>	Der Index umfasst festverzinsliche, in Euro denominierte Anleihen mit Investment-Grade-Rating. Die Aufnahme basiert auf der Währung der Emission und nicht auf dem Domizilland des Emittenten. Die wichtigsten Sektoren des Index sind Staatsanleihen, Unternehmensanleihen, regierungsnahen Anleihen und verbriefte Emissionen.
<b>Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged, USD)</b>	Bei dem Index handelt es sich um ein führendes Maß für globale festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating. Diese mehrere Währungen enthaltende Benchmark umfasst Anleihen von Emittenten der Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzwesen aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index ist Bestandteil der Global Aggregate and Multiverse Indizes.
<b>Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, abgesichert, USD)</b>	Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahen Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind. Der Index ist voll in USD abgesichert.
<b>Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, nicht abgesichert, USD)</b>	Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahen Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind.
<b>Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD)</b>	Der Index misst den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade und umfasst Treasuries, regierungsnahen Titel und Unternehmensanleihen, Mortgage Backed Securities (Agency Fixed Rate und Hybrid Variable Rate Mortgage Pass-Throughs), forderungsbesicherte Anleihen (Asset-Backed Securities sowie Commercial Mortgage-Backed Securities (Agency und Non-Agency)). Der Index ist eine breit angelegte Benchmark, die den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade misst. Dazu gehören Treasuries, regierungsnahen Titel und Unternehmensanleihen, hypothekarisch besicherte Anleihen (MBS), forderungsbesicherte Anleihen (ABS) sowie besicherte MBS.
<b>Cboe S&amp;P 500 PutWrite Index</b>	Der Index bildet den Wert einer passiven Anlagestrategie ab, die aus einem Overlay von S&P 500 („SPX“) Short-Verkaufsoptionen über ein in ein- und dreimonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besteht. Die SPX-Verkaufsoptionen werden At-The-Money ausgeführt und monatlich verkauft.
<b>Cboe S&amp;P 500 One-Week PutWrite Index</b>	Der Index bildet die Wertentwicklung einer hypothetischen Strategie ab, die wöchentlich eine At-the-Money (ATM) S&P 500 Index (SPX)-Verkaufsoption verkauft. Die Fälligkeit der geschriebenen SPX-Verkaufsoption ist eine Woche vor Verfall. Die geschriebene SPX-Verkaufsoption wird über ein in einmonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besichert. Der Index wird wöchentlich aktualisiert, üblicherweise jeden Freitag.

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### **FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY)**

Der Index misst die Wertentwicklung von auf CNY lautenden, festverzinslichen Staatsanleihen in stückloser Form sowie von Policy Bank Bonds, die auf dem chinesischen Festland ausgegeben wurden. Die folgenden Instrumente sind ausgeschlossen: Sparbriefe, spezielle Staatsanleihen, Zentralbankwechsel, Privatplatzierungen und abrufbare und kündbare Anleihen.

#### **FTSE EPRA Nareit Developed Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von börsennotierten Immobiliengesellschaften und Real Estate Investment Trusts (REITs) in Industrieländern messen soll. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.

#### **FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von an der New York Stock Exchange oder der NASDAQ notierten steuerbegünstigten Immobiliengesellschaften (REITs) abbildet. Eigenkapital-REITs umfassen alle steuerbegünstigten REITs mit mehr als 50 Prozent des Gesamtvermögens an qualifizierten Immobilienanlagen mit Ausnahme von grundpfandrechtl. gesicherten Hypotheken.

#### **ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR)**

Der Index misst die Wertentwicklung von in Euro und GBP denominierten Unternehmensanleihen unterhalb von Investment Grade von Nichtfinanzunternehmen, die am Eurobondmarkt und Sterling- oder Euro-Inlandsmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in einem Emittenten ist auf 3 % begrenzt. Der Index enthält alle nicht finanziellen Wertpapiere des ICE BofA European Currency High Yield Index, begrenzt aber das Engagement bei individuellen Emittenten auf 3 %.

#### **ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in USD, CAD, GBP und EUR denominierten Unternehmensanleihen unterhalb Investment Grade ab, die an den wichtigsten Inlands- oder Eurobondmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in jedem der im Index enthaltenen Emittenten ist auf maximal 2 % des Index begrenzt. Der Index enthält alle Wertpapiere des ICE BofA Global High Yield Index, begrenzt aber das Emittentenrisiko auf 2 %.

#### **ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von nicht finanziellen hybriden Unternehmensanleihen mit Investment Grade ab, die öffentlich an wichtigen Inlands- und Eurobond-Märkten begeben werden, wobei die Gewichtung jedes Emittenten auf maximal 5 % begrenzt ist.

#### **ICE BofA US Dollar 1-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)**

Der Index ist eine weit verbreitete Benchmark für kurzfristige Zinssätze. Er gibt einen Hinweis auf die Durchschnittskurse, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

#### **ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts ab, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SOFR-Satz zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments mit genau derselben angegebenen Fälligkeit und einem Kupon in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Werktag verkauft (mit einer Rendite in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses) und in ein neues Instrument umgewandelt wird.

#### **ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen ohne Investment Grade ab, die öffentlich auf dem US-Inlandsmarkt begeben werden. Neben der Erfüllung anderer Kriterien müssen zulässige Wertpapiere ein Rating unterhalb von Investment Grade aufweisen (basierend auf dem Durchschnitt der Ratings von Moody's, S&P und Fitch) und Risiken gegenüber G10 FX-Ländern, Westeuropa oder Gebieten der USA und Westeuropas ausgesetzt sein. Wertpapiere, die rechtlich in Verzug sind, werden vom Index ausgeschlossen. Indexkomponenten sind kapitalisierungsgewichtet, sofern die Gesamtallokation bei einem einzelnen Emittenten 2 % nicht überschreitet.

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

**ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR)**

Der Index ist eine Teilmenge des ICE BofA All Maturity Euro Government Index einschließlich aller Wertpapiere mit einer Fälligkeit von weniger als 1 Jahr und einem Rating von AAA. Der Index bildet die Wertentwicklung von in EUR denominierten Staatsanleihen ab, die von den Euro-Mitgliedsländern öffentlich entweder auf dem Eurobondmarkt oder dem Heimatmarkt des Emittenten begeben werden. Die zulässigen Länder müssen Euro-Mitglieder sein, über ein Investment Grade Rating für langfristige Staatsschulden in Fremdwährung verfügen (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch) und über mindestens eine leicht zugängliche, transparente Preisquelle für ihre Wertpapiere verfügen. Um für die Aufnahme in Betracht gezogen zu werden, muss ein Land zum ersten eines Monats Euro-Mitglied sein.

**ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD)**

Der Index besteht aus einer einzelnen US Treasury Bill-Emission, die zu Beginn eines jeden Monats gekauft und einen ganzen Monat lang gehalten wird. Zum Monatsende wird diese Emission verkauft und durch eine neu ausgewählte Emission ersetzt, die am nächsten zu drei Monaten ab dem Datum der Neuausrichtung, aber nicht darüber hinaus, fällig wird.

**JP Morgan Asia Credit Index (JACI) (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ab. JACI ist ein marktkapitalgewichteter Index, der Staatsanleihen, quasistaatliche und Unternehmensanleihen umfasst und nach Ländern, Sektoren und Kreditrating unterteilt ist.

**JPMorgan ESG Asia Credit High Yield Index (Total Return, USD) (JESG JACI)**

Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ohne Investment Grade ab, die bestimmte ESG-Kriterien erfüllen.

**JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index (CEMBI)-Diversified (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen aus Schwellenländern ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Unternehmensschuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JPMorgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

**JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) - Global Diversified (Total Return, USD)**

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Schuldtiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Kredite und Euroanleihen) ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index erfasst ein breites, umfassendes Universum von Emissionen aus Schwellenländern. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Schuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JPMorgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

**JPMorgan ESG CEMBI - Broad Diversified (Total Return, USD)**

Der Index bildet in US-Dollar denominierte fest- und variabel verzinsliche Schuldtitel aus Schwellenländern ab, die von Unternehmen emittiert werden. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten und zu entfernen.

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

<p><b>JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Index (Total Return, USD)</b></p>	<p>Der Index bildet die Wertentwicklung von liquiden, in US-Dollar denominierten fest- und variabel verzinslichen Schultiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Darlehen und Eurobonds) ab, die eine Restlaufzeit von mindestens 2,5 Jahren haben. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten und zu entfernen.</p>
<p><b>JPMorgan Government Bond Index (GBI) Emerging Markets - Global Diversified (Total Return, Unhedged, USD)</b></p>	<p>Der Index bildet die Wertentwicklung von Anleihen in lokaler Währung ab, die von Regierungen der Schwellenländer ausgegeben wurden, einschließlich Schwellenländern aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index enthält nur Länder, die für den Großteil der internationalen Anleger zugänglich sind. Länder mit expliziten Kapitalkontrollen sind ausgeschlossen. Die diversifizierte Version des Index ist nach Marktkapitalisierung gewichtet. Die Höchstgewichtung pro Land beträgt 10 %. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JPMorgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schultitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.</p>
<p><b>MSCI All Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)</b></p>	<p>Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktpformance von Industrie- und Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, die 23 Industrie- und 24 Schwellenländerindizes umfassen. Die enthaltenen Indizes aus Industrieländern sind: Australien, Österreich, Belgien, Kanada, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Hongkong, Irland, Israel, Italien, Japan, die Niederlande, Neuseeland, Norwegen, Portugal, Singapur, Spanien, Schweden, die Schweiz, das Vereinigte Königreich und die USA. Die enthaltenen Schwellenländerindizes sind: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stufte MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs.</p>
<p><b>MSCI All Country World (ACWI) Value Index</b></p>	<p>Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von Large- und Mid-Cap-Aktien mit, im Großen und Ganzen, Value-Merkmalen aus 23 entwickelten Märkten und 24 Schwellenmärkten repräsentiert. Die Merkmale des Value-Anlagestils für diesen Index werden anhand von drei Variablen definiert: Verhältnis zwischen Kurs und Buchwert (KBV), Verhältnis zwischen Kurs und Gewinn (KGV) basierend auf Prognosen für die nächsten zwölf Monate und Dividendenrendite.</p>
<p><b>MSCI China A Onshore Index (Total Return, CNY)</b></p>	<p>Der Index ist kapitalisierungsgewichtet und besteht aus den A-Aktien großer und mittlerer Marktkapitalisierung von Unternehmen der VR China, die an den Börsen von Shanghai und Shenzhen notiert sind. Der Index erfasst die vertretenen Large- und Mid-Caps unter den an den Börsen Shanghai und Shenzhen notierten chinesischen Wertpapieren. Der Index basiert auf der MSCI Global Investable Market Indexes („GIMI“) Methodik. Es handelt sich dabei um einen umfassenden und konsistenten Ansatz zur Indexerstellung, der aussagekräftige globale Ansichten und überregionale Vergleiche über das gesamte Marktkapitalisierungsspektrum, Sektoren und Stilsegmente hinweg ermöglicht. Diese Methodik zielt darauf ab, eine umfassende Abdeckung der relevanten Anlagegelegenheiten zu bieten, wobei ein deutlicher Schwerpunkt auf der Indexliquidität, der Investitionsfähigkeit und der Replizierbarkeit liegt. Der Index wird vierteljährlich – im Februar, Mai, August und November – mit dem Ziel überprüft, Veränderungen an den zugrunde liegenden Aktienmärkten zeitnah zu berücksichtigen und gleichzeitig übermäßige Indexumsschläge zu begrenzen.</p>

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

**MSCI China All Shares Net Index (Total Return, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Aktienmarktpower chinesischer Anteilklassen messen soll, die in Hongkong, Shanghai, Shenzhen und außerhalb Chinas notiert sind. Er deckt das integrierte Aktienuniversum des MSCI China ab, das A-Aktien, B-Aktien, H-Aktien, Red Chips, P-Chips und ausländische Notierungen außerhalb Chinas oder Hongkongs (z. B. ADRs) umfasst. A-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren in Renminbi und unterliegen den Vorschriften für ausländische Investitionen (QFII). B-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren Fremdwährungen (Shanghai USD, Shenzhen HKD) und sind für ausländische Anleger zugänglich. H-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an der Börse in Hongkong und anderen ausländischen Börsen gehandelt. Red Chips und P-Chips sind Papiere von Unternehmen, die außerhalb Chinas gegründet werden und an der Börse in Hongkong handeln. Red Chips werden in der Regel vom Staat oder einer Provinz oder Gemeinde kontrolliert. P-Chips sind nicht staatliche chinesische Unternehmen, die außerhalb des Festlandes gegründet wurden und in Hongkong gehandelt werden. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.

**MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktpower von Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus den folgenden 24 Schwellenländerindizes: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stufte MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs.

**MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktpower von entwickelten Märkten in Europa messen soll.

**MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY)**

Der Index soll die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des japanischen Marktes messen.

**MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktpower von 23 entwickelten Märkten messen soll.

**Russell 1000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Large-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 1000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.

**Russell 2000 Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des US-Aktienmarktes misst. Er enthält etwa 2.000 der kleinsten Wertpapiere im Russell 3000 Index (der die Performance der 3.000 größten US-amerikanischen Aktiengesellschaften anhand der gesamten Marktkapitalisierung misst). Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

**Russell 2000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 2000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.

**S&P 500 Index (Total Return, Net of Tax, USD)**

Der Index ist um den Streubesitz bereinigt und marktkapitalisierungsgewichtet, mit Schwerpunkt auf dem Large-Cap-Segment des US-Aktienmarktes. Er umfasst einen wesentlichen Anteil des Gesamtwerts des Marktes.

**Gewichteter Durchschnitt aus 2/3 JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) und 1/3 JP Morgan GBI EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD).**

Der kombinierte Index setzt sich zu 2/3 aus dem JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total return, USD) (wie zuvor beschrieben) und zu 1/3 aus dem JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total return, USD, nicht währungsgesichert) (wie zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet.

**50% JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD), 25% JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25% JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD)**

Der kombinierte Index setzt sich zu 25 % aus dem JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified (wie zuvor beschrieben), zu 25 % aus dem JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (wie zuvor beschrieben) und zu 50 % aus dem JP Morgan GBI EM Global Diversified Index (wie zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet.

**50% Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index / 50% Cboe S&P 500 PutWrite Index**

Der kombinierte Index setzt sich zu 50 % aus dem CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) und zu 50 % aus dem CBOE S&P 500 PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) zusammen.



## Anhang VII

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT)

Nähere Angaben zu den Managern, Sub-Investment-Managern und Unterberatern sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt.

Fondsname	Manager	Sub-Investment-Manager	Unterberater (verbunden)	Unterberater (nicht verbunden)
5G Connectivity	Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“)	Neuberger Berman Investment Advisers LLC („NBIA“)		
		Neuberger Berman Asia Limited („NBAL“)		
Asian Debt – Hard Currency	NBAMIL	NBIA		
		Neuberger Berman Singapore Pte. Limited („NBS“)		
China A-Share Equity	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
China Bond	NBAMIL	NBIA	Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited („NB Shanghai“)	
		NBS		
		NBAL		
China Equity	NBAMIL			Green Court Capital Management Limited („Green Court“)
CLO Income	NBAMIL	NBIA		
Commodities	NBAMIL	NBIA		
		NBEL		
Corporate Hybrid Bond	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Emerging Market Debt – Hard Currency	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Emerging Market Debt – Local Currency	NBAMIL	NBIA	NB Shanghai	
		NBS		
Emerging Market Debt Blend	NBAMIL	NBIA	NB Shanghai	
		NBS		
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Emerging Markets Equity	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
Emerging Markets Select Equity	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
Euro Bond Absolute Return	NBAMIL			
Euro Opportunistic Bond	NBAMIL			
European High Yield Bond	NBAMIL	NBIA		
European Sustainable Equity	NBAMIL	NBIA		
Event Driven	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Global Bond	NBAMIL	NBIA		
		NBS		

## Anhang VII (Fortsetzung)

## MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Fondsname	Manager	Sub-Investment-Manager	Unterberater (verbunden)	Unterberater (nicht verbunden)
Global Diversified Income FMP – 2024	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Flexible Credit Income	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global High Yield SDG Engagement	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global High Yield Sustainable Action	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Investment Grade Credit	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Global Opportunistic Bond	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Real Estate Securities	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
Global Sustainable Equity	NBAMIL	NBIA		
Global Equity Megatrends	NBAMIL	NBIA		
High Yield Bond	NBAMIL	NBIA		
InnovAsia 5G	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBAL		
Japan Equity Engagement	NBAMIL	Neuberger Berman East Asia Limited („NBEAL“)		
Macro Opportunities FX	NBAMIL	NBIA		
Multi-Asset Income	NBAMIL	NBIA		
		Neuberger Berman Canada ULC („NB Canada“)		
Next Generation Mobility	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
Next Generation Space Economy	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Short Duration Emerging Market Debt	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Short Duration High Yield SDG Engagement	NBAMIL	NBIA		
Strategic Income	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Sustainable Asia High Yield	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBS		
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	NBAMIL	NBIA		
		NBS		

## Anhang VII (Fortsetzung)

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Fondsname	Manager	Sub-Investment-Manager	Unterberater (verbunden)	Unterberater (nicht verbunden)
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBS		
Systematic Global Sustainable Value	NBAMIL	NBIA		
		NB Canada		
Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL			
Uncorrelated Strategies	NBAMIL	NBIA	NB Alternatives Advisers LLC („NBAA“)	AltIQ LLP
				BH-DG Systematic Trading LLP
				P/E Global LLC
				True Partner Capital USA Holding Inc
				Alcova Asset Management LLP
				Sandbar Asset Management LLP
				Crabel Capital Management, LLC
				AllianceBernstein L.P.
				Portman Square Capital LLP
				Soloda Investment Advisors LLP
XXXXXXXXXXXXX	NBAMIL	NBIA	NBAA	AltIQ LLP
				True Partner Capital USA Holding Inc
				Alcova Asset Management LLP
				Crabel Capital Management, LLC
				Portman Square Capital LLP
				Sandbar Asset Management LLP
US Equity	NBAMIL	NBIA		
US Equity Index PutWrite	NBAMIL	NBIA		
US Large Cap Value	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
US Long Short Equity	NBAMIL	NBIA		
US Multi Cap Opportunities	NBAMIL	NBIA		
US Real Estate Securities	NBAMIL	NBIA		
US Small Cap	NBAMIL	NBIA		
US Small Cap Intrinsic Value	NBAMIL	NBIA		

## Anhang VIII

### OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT)

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-6-Portfolio für die Zwecke der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rats vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) kategorisiert: Neuberger Berman CLO Income Fund (CLO Bond Portfolio), Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund, Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (US Equity Portfolios), Neuberger Berman China Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund, XXXXXXXXXXXX (Multi Strategy Portfolios), Neuberger Berman Commodities Fund (Quantitative and Multi Asset Portfolios) und Neuberger Berman Event Driven Fund (Global Equity Portfolios).

Für die Zwecke der Taxonomie-Verordnung wird darauf hingewiesen, dass die Anlagen in zugrunde liegenden Artikel-6-Portfolios den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht Rechnung tragen.

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-8-Portfolios für die Zwecke der SFDR klassifiziert: Neuberger Berman High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund, Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (High Yield Bond Portfolios), Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund, Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund, Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund, Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund, Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (Emerging Market Debt Portfolios), Neuberger Berman China Bond Fund (China Bond Portfolios), Neuberger Berman Global Bond Fund, Neuberger Berman Strategic Income Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund, Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (Fixed Maturity Portfolios), Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund, Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (Euro Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund, Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund (Quantitative and Multi Asset Portfolios), Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman US Equity Fund, Neuberger Berman US Small Cap Fund, Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund, Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (US Equity Portfolios), Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund, Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund, Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (Global Equity Portfolios), Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (Real Estate Portfolios), Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman 5G Connectivity Fund, Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund, Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund, Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund, Neuberger Berman Metaverse Fund, Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (Thematic Equity Portfolios), Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund and Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (Sustainable Equity Portfolios) (die „Artikel-8-Portfolios“). Informationen zu den ökologischen und sozialen Merkmalen der Artikel-8-Fonds, mit Ausnahme der nicht aufgelegten Fonds, sind im Anhang unten verfügbar. Wir machen keine weiteren Angaben zum Neuberger Berman Metaverse Fund, da er nicht aufgelegt wurde.

Der Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (Emerging Market Debt Portfolios) wurde zum Zwecke der SFDR als Artikel-9-Portfolio (das „Artikel-9-Portfolio“) kategorisiert.

Im Einklang mit den Anforderungen von Artikel 11 der SFDR wurden keine Informationen in Bezug auf jedes Artikel-8-Portfolio und das Artikel-9-Portfolio in diesen Anhang aufgenommen. Sofern nicht anderweitig in diesem Anhang definiert, haben Begriffe in Großbuchstaben die ihnen in diesem Prospekt verliehene Bedeutung.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300VLRPBFFXL0DB81

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	54	96 %
Daten von Dritten	4,8	

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen oder die neue Kohlekraftwerke ausbauen (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“), für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und



überprüfbareren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	5,4 %	Mexiko
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,7 %	Südafrika
POLAND GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,8 %	Polen
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,6 %	Südafrika
MALAYSIA GOVERNMENT	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,8 %	Malaysia
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,7 %	Mexiko
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,7 %	Südafrika
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	Südafrika
POLAND GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	Polen
ROMANIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	Rumänien
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	Indonesien
TURKEY (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	Türkei
TITULOS DE TESORERIA	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Kolumbien
COLOMBIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Kolumbien
CZECH REPUBLIC RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Tschechische Republik

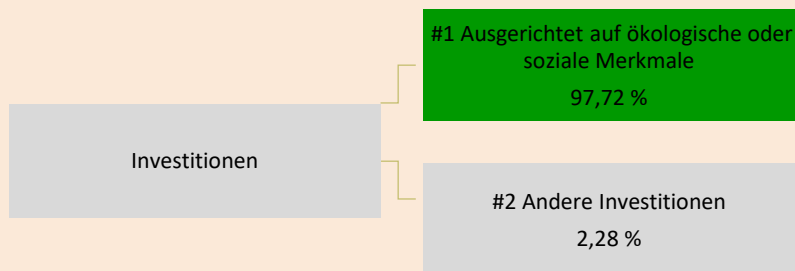


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der ökologisch und/oder sozial ausgerichteten Portfolioanlagen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,12 %
D – Energieversorgung	1,53 %
F – Baugewerbe/Bau	0,05 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,03 %
H - Verkehr und Lagerei	0,07 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,19 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,05 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	94,57 %
Keine	2,39 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.



**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

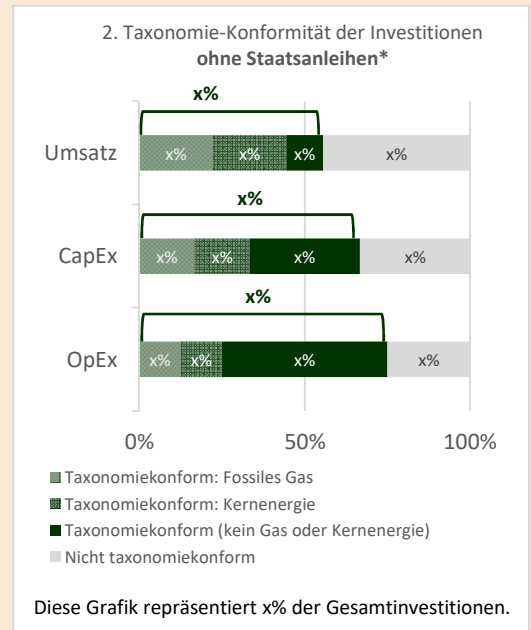
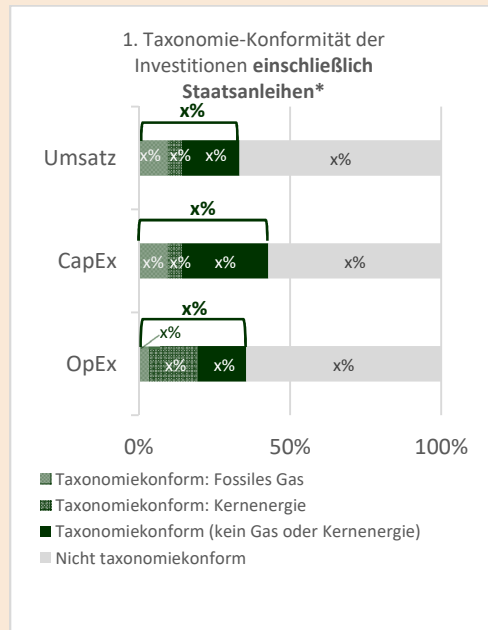
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Taxonomie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

k. A.

- 
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300M7KHGG3BTZ3979

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei der Verwirklichung der UN-Ziele einer nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	51	96 %
Daten von Dritten	3,8	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindeststrategie des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen oder die neue Kohlekraftwerke ausbauen (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“), für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und

überprüfbar Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC RegS	H - Verkehr und Lagerei	2,6 %	Aserbaidschan
PETROLEOS MEXICANOS	B - Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,4 %	Mexiko
ECUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,7 %	Ecuador
ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	Argentinien
OMAN GOVERNMENT BOND MTN RegS	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	Oman
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES)	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	Mexiko
ANGOLA GOVERNMENT BOND RegS	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,5 %	Angola
QATAR GOVERNMENT BOND RegS	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	Katar
1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD RegS	K - Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,4 %	Malaysia
NK KAZMUNAYGAZ AO RegS	B - Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,3 %	Kasachstan
STATE OIL CO OF THE AZERBAIJAN REP RegS	B - Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,2 %	Aserbaidschan
COTE D IVOIRE REPUBLIC OF RegS	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	Elfenbeinküste
ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	Argentinien
INDONESIA REPUBLIC OF	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	Indonesien
SERBIA (REPUBLIC OF) RegS	O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,0 %	Republik Serbien

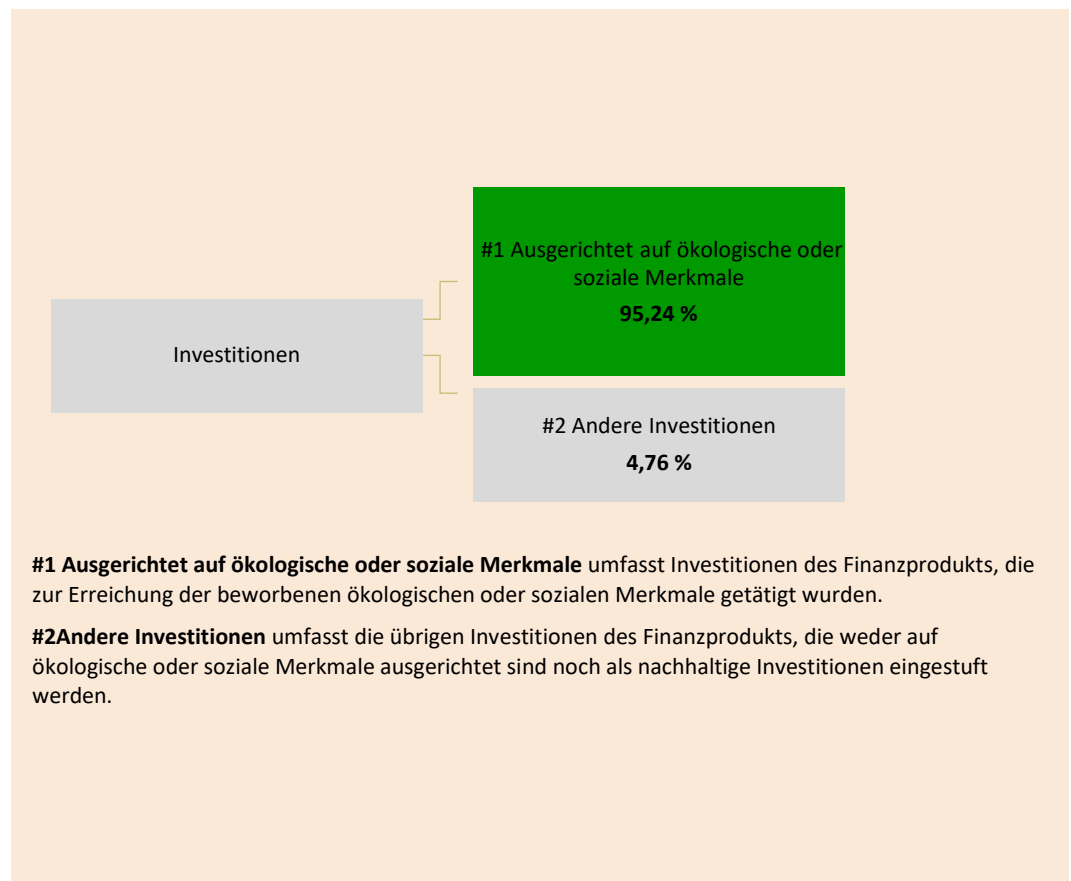


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der ökologisch und/oder sozial ausgerichteten Portfolioanlagen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und/oder der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022

<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	7,33 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	6,11 %
D – Energieversorgung	2,86 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,00 %
F – Baugewerbe/Bau	0,11 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,32 %
H - Verkehr und Lagerei	3,41 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,00 %
J – Information und Kommunikation	0,29 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	12,27 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,03 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,25 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	63,37 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,00 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,67 %
Keine	0,96 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

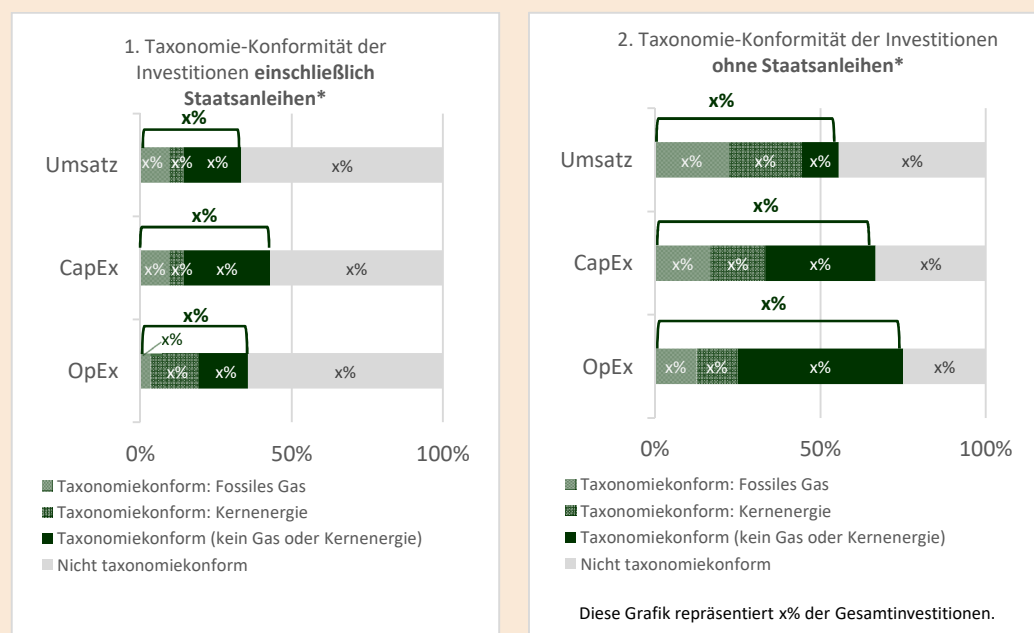
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.





## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300JASQ1JIDYO8X22

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

<b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>	
<span style="color: green;">● ●</span> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<span style="color: green;">●</span> <span style="color: grey;">●</span> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%  <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div>  <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.  <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel                 </div>  <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“), Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei der Verwirklichung der UN-Ziele einer nachhaltigen Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	54	95 %
Daten von Dritten	4,6	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindeststrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“) für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und

überprüfbar Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,0 %	Südafrika
NB CHINA BOND FD USD ZA HEDGED	k. A.	2,9 %	China
POLAND GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,4 %	Polen
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,9 %	Mexiko
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	Südafrika
TITULOS DE TESORERIA B	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	Kolumbien
POLAND GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,0 %	Polen
THAILAND KINGDOM OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,9 %	Thailand
CZECH REPUBLIC RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,9 %	Tschechische Republik
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,8 %	Indonesien
ROMANIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,8 %	Rumänien
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,8 %	Südafrika
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,8 %	Mexiko
MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,7 %	Malaysia
FONDO MIVIVIENDA SA RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,7 %	Peru



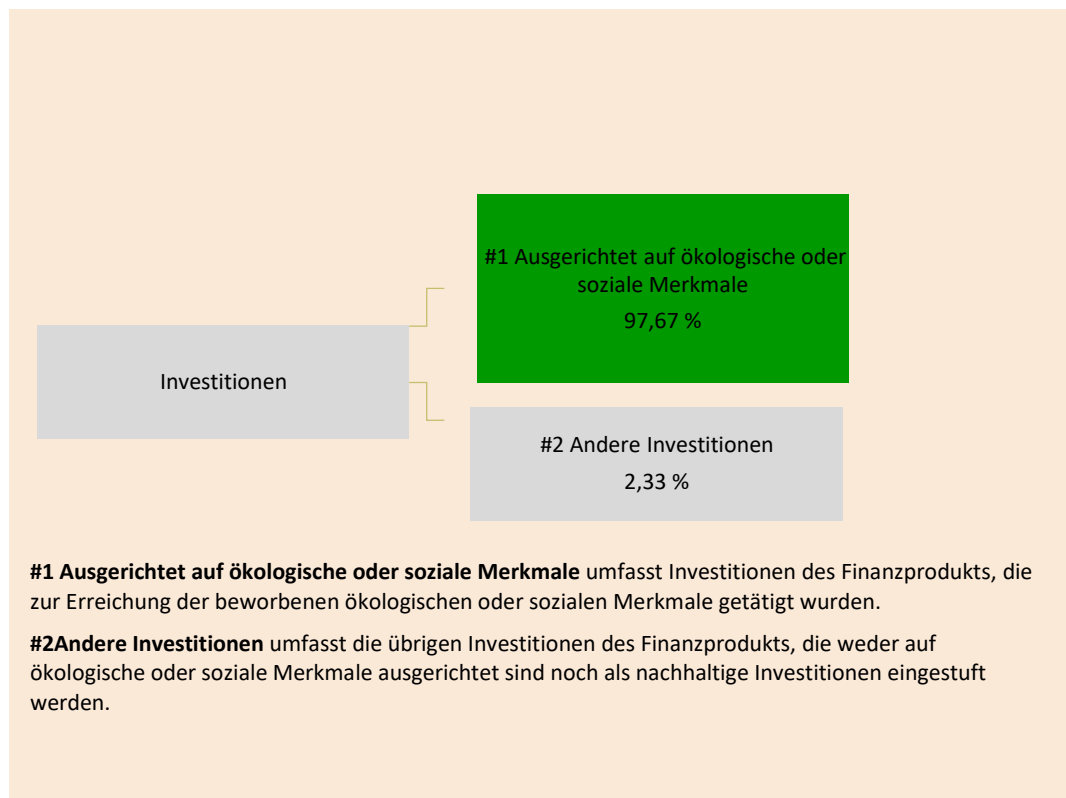


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der ökologisch und/oder sozial ausgerichteten Portfolioanlagen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022

<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	4,61 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,89 %
D – Energieversorgung	3,68 %
F – Baugewerbe/Bau	0,39 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,76 %
H - Verkehr und Lagerei	1,61 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,69 %
J – Information und Kommunikation	1,23 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	16,39 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,11 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,76 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	63,27 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,17 %
U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,38 %
Keine	1,05 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In

fossiles

Gas In Kernenergie

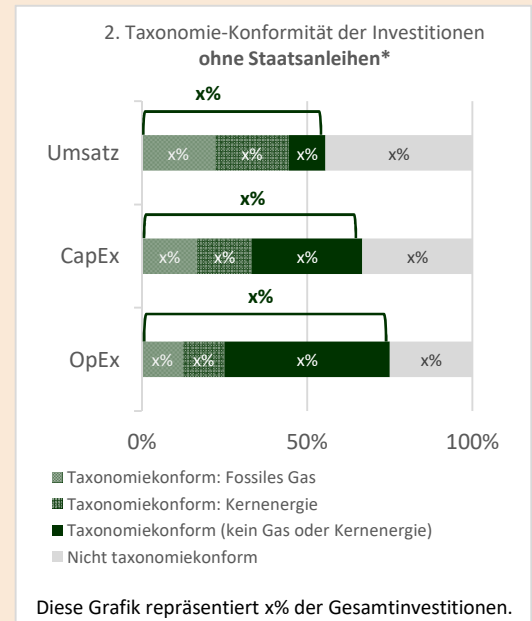
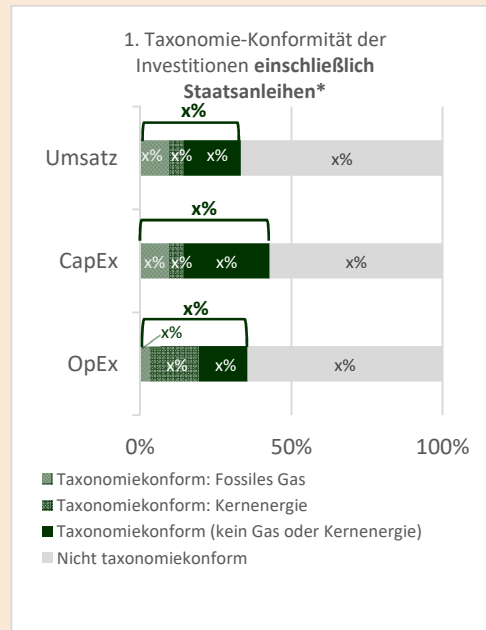
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 54930058PUF4SZOVOD17

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

<b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>	
<span style="color: green;">● ●</span> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<span style="color: green;">●</span> <span style="color: grey;">●</span> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmen beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („THG“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

Das Portfolio erreichte eine CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität, die mindestens 10 % unter der des breiteren Anlageuniversums asiatischer Schuldtitel lag, das durch den JP Morgan Asian Credit Index (Total Return, USD) (der „Referenzwert“) repräsentiert wird.

Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Referenzwert nachzubilden (zu tracken). Er wird hier lediglich zu Zwecken des Vergleichs der Wertentwicklung herangezogen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf dem Durchschnitt der Daten vom 30. September 2022 und vom 31. Dezember 2022, den einzigen beiden Quartalsenden des Bezugszeitraums, der auf die Einführung dieser Verpflichtung folgte (eingeführt am 19. August 2022). Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Zum 31. Dezember 2022 erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Schuldtitel, das durch den Referenzwert repräsentiert wird, der auf ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters basiert.

- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	59	97 %
Daten von Dritten	5,6	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Darüber hinaus schloss das Portfolio ab dem 19. August 2022 Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren, sowie von bestimmten Emittenten mit erheblichen Einnahmen aus Palmöl, Erwachsenenunterhaltung und Stromerzeugung aus Kernkraft. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen werden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
INDONESIA REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,9 %	Indonesien
INDONESIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,1 %	Indonesien
TSMC ARIZONA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,5 %	Taiwan (Republic of China)
MINMETALS BOUNTEOUS FINANCE (BVI) RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,4 %	China
CMB INTERNATIONAL LEASING MANAGEME MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	China
LENOVO GROUP LTD RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,3 %	China
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	China
HUARONG FINANCE II CO LTD MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	China
RELIANCE INDUSTRIES LTD RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,0 %	Indien
AIA GROUP LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Hongkong
CHINA RESOURCES LAND LTD MTN RegS	F – Baugewerbe/Bau	0,9 %	China
PERTAMINA PT RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,9 %	Indonesien
SK TELECOM CO LTD RegS	J – Information und Kommunikation	0,9 %	Korea (South), Republic of
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	China
INDONESIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,9 %	Indonesien

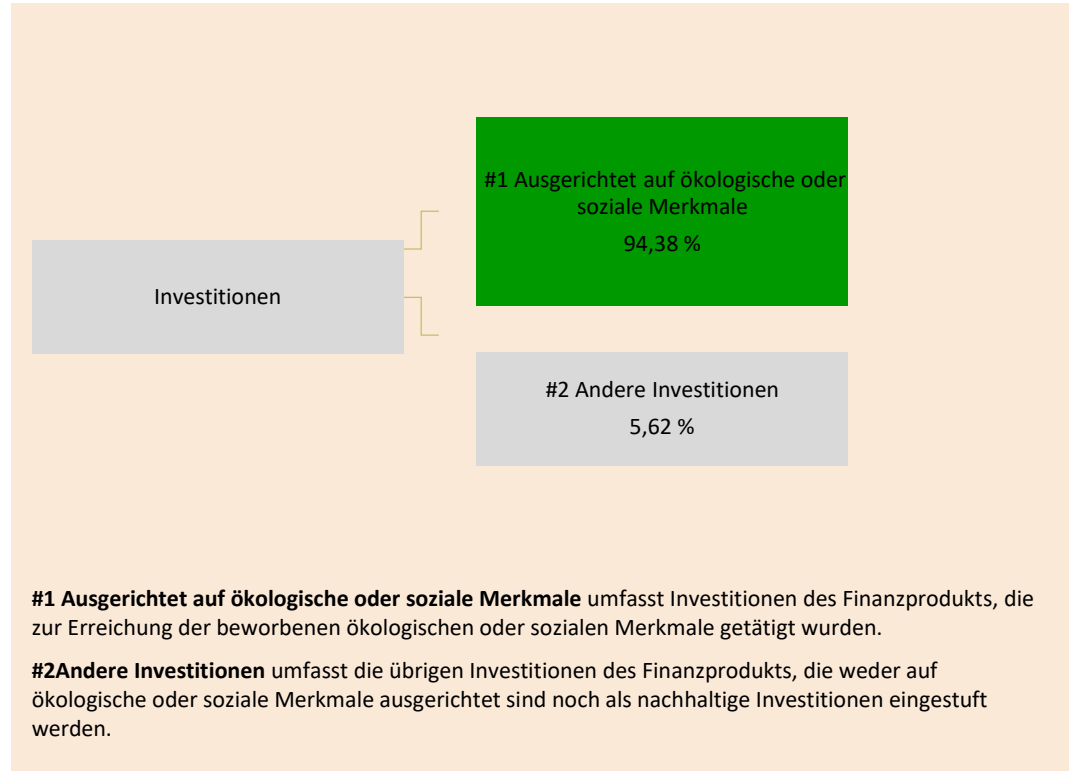


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der ökologisch und/oder sozial ausgerichteten Portfolioanlagen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022

<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenwerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,71 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	9,63 %
D – Energieversorgung	5,91 %
F – Baugewerbe/Bau	4,54 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,38 %
H - Verkehr und Lagerei	1,50 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,94 %
J – Information und Kommunikation	4,36 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	53,18 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,45 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	7,78 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,84 %
Keine	1,77 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

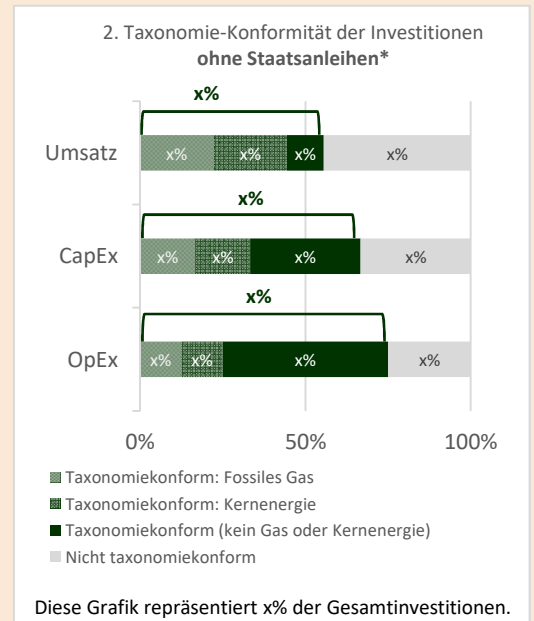
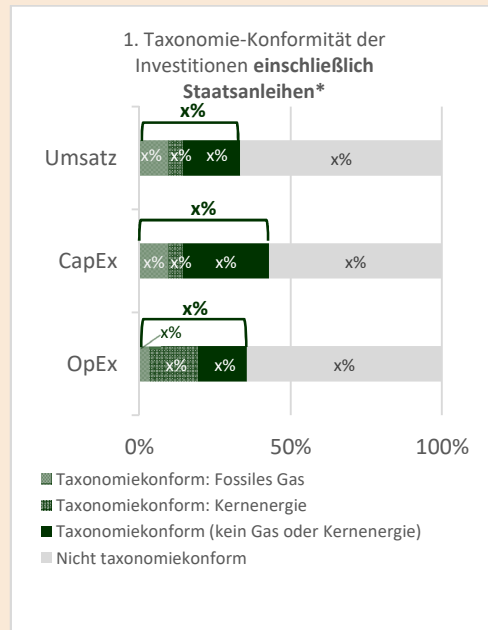
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.





## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstießen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

## Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

k. A.

---

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300J30SXW5866TW70

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 28.08 %* an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“), Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, "SDGs"), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	55	95 %
Daten von Dritten	4,2	

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („**SDGs**“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens haben der Manager und der Sub-Investment-Manager Investitionen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigten, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager trugen bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Emittenten, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen sowie Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „**PAIs**“) für Unternehmensemittenten und THG-Emissionsintensität und soziale Verstöße in den Ländern, in die investiert wird für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 haben weder der

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Manager noch der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.





## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
2. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Investitionen innerhalb des Portfolios, die ökologische oder soziale Merkmale bewarben, nämlich: die staatlichen PAIs für staatliche Emittenten und die THG-Emissionen, der CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, die THG-Emissionsintensität, das Engagement in fossilen Brennstoffen und die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen für die Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
STATE OIL CO OF AZERBAIJAN REPUBLI MTN	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,4 %	Aserbaidschan
NB EURO SHORT TERM ENHANC USD CL Z	k. A.	1,4 %	Irland
BRAZIL MINAS SPE RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	Brasilien
REPUBLIC OF COLOMBIA	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,2 %	Kolumbien
SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC RegS	H - Verkehr und Lagerei	1,1 %	Aserbaidschan
1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Malaysia
PETROLEOS MEXICANOS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,0 %	Mexiko
ANGOLA GOVERNMENT BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,0 %	Angola
QNB FINANCE LTD MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Katar
QATAR PETROLEUM RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,9 %	Katar
EGYPT (ARAB REPUBLIC OF) MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,9 %	Ägypten
SAUDI ARABIAN OIL CO MTN RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,9 %	Saudi-Arabien
COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD RegS	D – Energieversorgung	0,9 %	Mexiko
QATAR GOVERNMENT BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,8 %	Katar
SASOL FINANCING USA LLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Südafrika

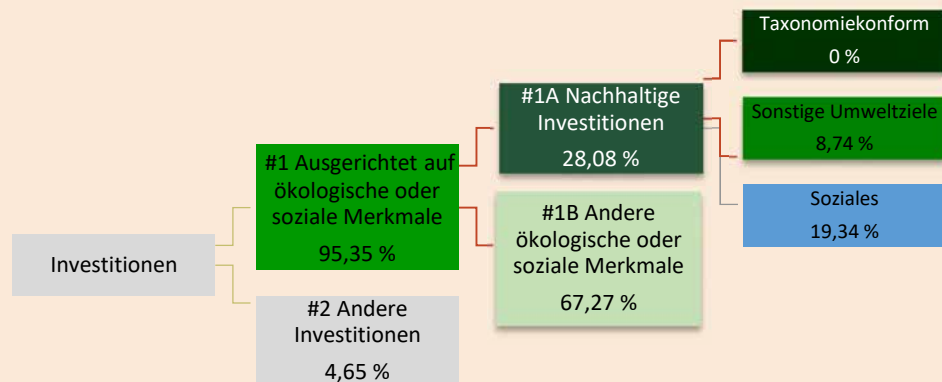


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Zum 31. Dezember 2022

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	8,89 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,58 %
D – Energieversorgung	3,35 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,00 %
F – Baugewerbe/Bau	0,44 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,34 %
H - Verkehr und Lagerei	2,36 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,73 %
J – Information und Kommunikation	0,30 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	51,31 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,52 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,07 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,83 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	23,36 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,35 %
U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,36 %
Keine	1,22 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

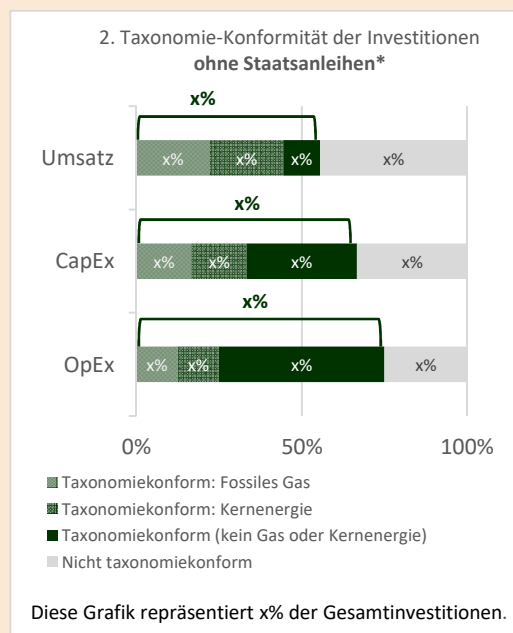
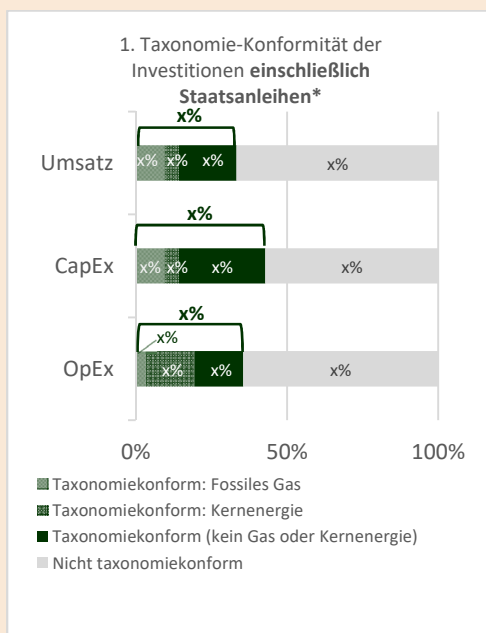
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

8,74 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

19,34 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300GFVJSXLRLRQ502

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 47,90 %\* an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarben und bewerben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen.<sup>1</sup> Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Das Portfolio erreichte eine CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität, die mindestens 30 % unter der des breiteren Anlageuniversums für Unternehmensanleihen aus Schwellenländern lag, das durch den Index JPMorgan CEMBI Diversified (USD) (der „**Index**“) repräsentiert wird. Davon ausgenommen sind Wertpapiere, die von Nicht-Unternehmensemittenten begeben wurden, zu denen öffentliche oder quasi-öffentliche Emittenten (d. h. staatliche Emittenten) sowie Barmittel oder Barmitteläquivalente gehören („**ausgeschlossene Wertpapiere**“). Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beteiligungen vom 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende des Bezugszeitraums, der auf die Einführung dieser Verpflichtung folgte (eingeführt am Montag, 3. Oktober 2022). Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren. Das Portfolio wurde aktiv verwaltet und bildete nicht den Index ab. Er wurde hier zu Vergleichszwecken für die Reduzierung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität und von aufgenommen.

Zum 31. Dezember 2022 erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung (wie von einem dritten Datenanbieter zugewiesen) als das breitere, durch den Index repräsentierte Universum der Unternehmensanleihen aus Schwellenländern.

- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	59	98 %
Daten von Dritten	5,5	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik::

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy fand für das Portfolio ab dem 3. Oktober 2022 Anwendung. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauen (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio verbietet außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle beziehen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandieren oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthalten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens haben der Manager und der Sub-Investment-Manager Investitionen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager trugen bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“) für die staatlichen Emittenten. THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Emittenten, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen sowie Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (für Unternehmensemittenten, zusammen die „**PAIs**“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — —  
*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- I. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
- II. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, nämlich: THG-Emissionen, CO2-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („**NACE**“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ROMANIA (REPUBLIC OF) MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Rumänien
COTE D IVOIRE (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	Elfenbeinküste
1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Malaysia
SANDS CHINA LTD	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,9 %	Macau
TSMC ARIZONA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,9 %	Taiwan (Republic of China)
TSMC GLOBAL LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Taiwan (Republic of China)
BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD (HONG K MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,7 %	Thailand
WYNN MACAU LTD RegS	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,7 %	Macau
COLOMBIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,7 %	Kolumbien
FIRST QUANTUM MINERALS LTD RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,7 %	Sambia

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

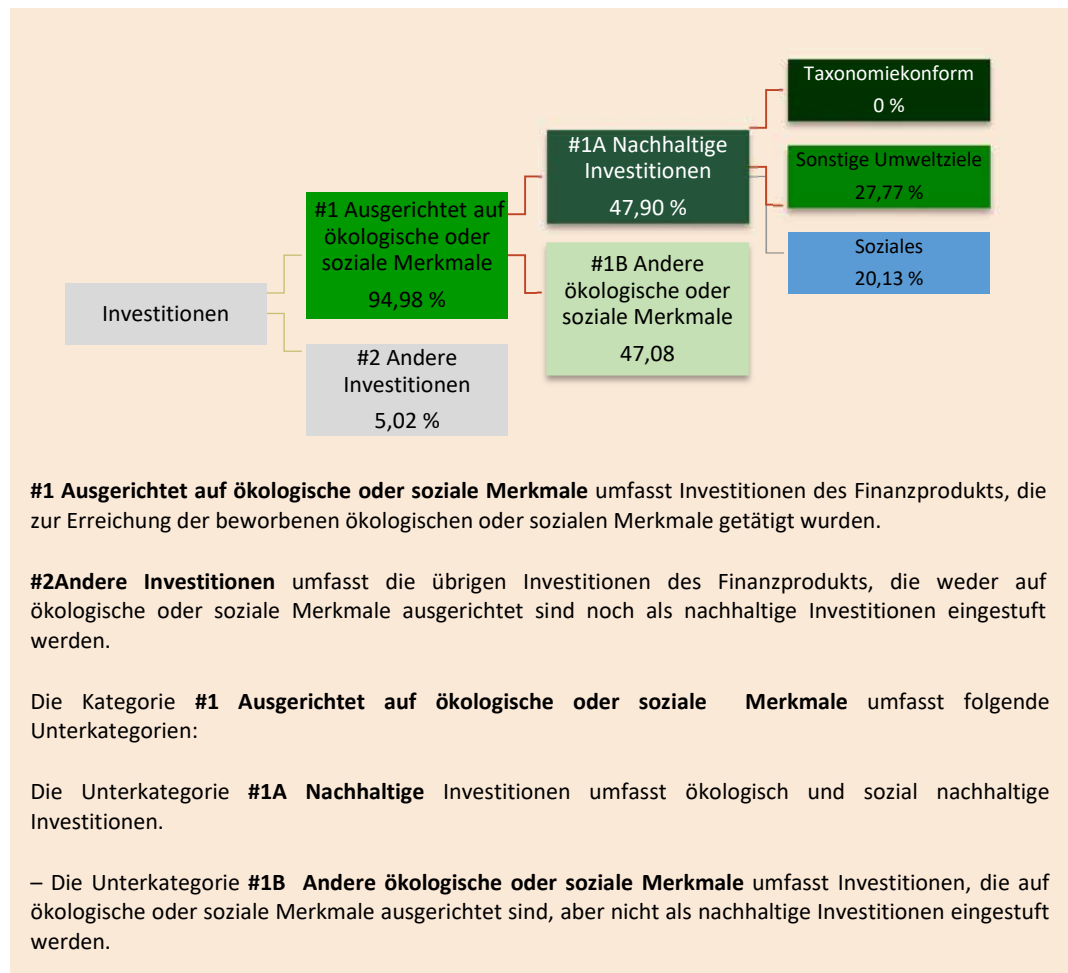
TEVA PHARMACEUTICAL NETHER	FINANCE	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	Israel
BOC AVIATION LTD MTN	RegS	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,6 %	Singapur
TEVA PHARMACEUTICAL NETHER	FINANCE	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	Israel
CELESTIAL MILES LTD	RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	Hongkong
VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC	RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	Indien



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?





Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Zum 31. Dezember 2022 hielt das Portfolio 48 % an nachhaltigen Investitionen. Es ist zu beachten, dass sich die in den vorvertraglichen Informationen gemachten Angaben auf den Berichtszeitraum 2023 beziehen, während sich dieser regelmäßige Bericht auf den Berichtszeitraum 2022 bezieht (vor Inkrafttreten von SFDR Level 2).

Es wird erwartet, dass das Portfolio seine Verpflichtung zu 50 % nachhaltigen Investitionen im Berichtszeitraum 2023 erreichen wird.

● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	8,91 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	13,35 %
D – Energieversorgung	2,51 %
F – Baugewerbe/Bau	1,25 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,94 %
H - Verkehr und Lagerei	0,94 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	3,03 %
J – Information und Kommunikation	4,57 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	55,07 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,38 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,06 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,34 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,03 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,24 %
Keine	0,38 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

in Kernenergie

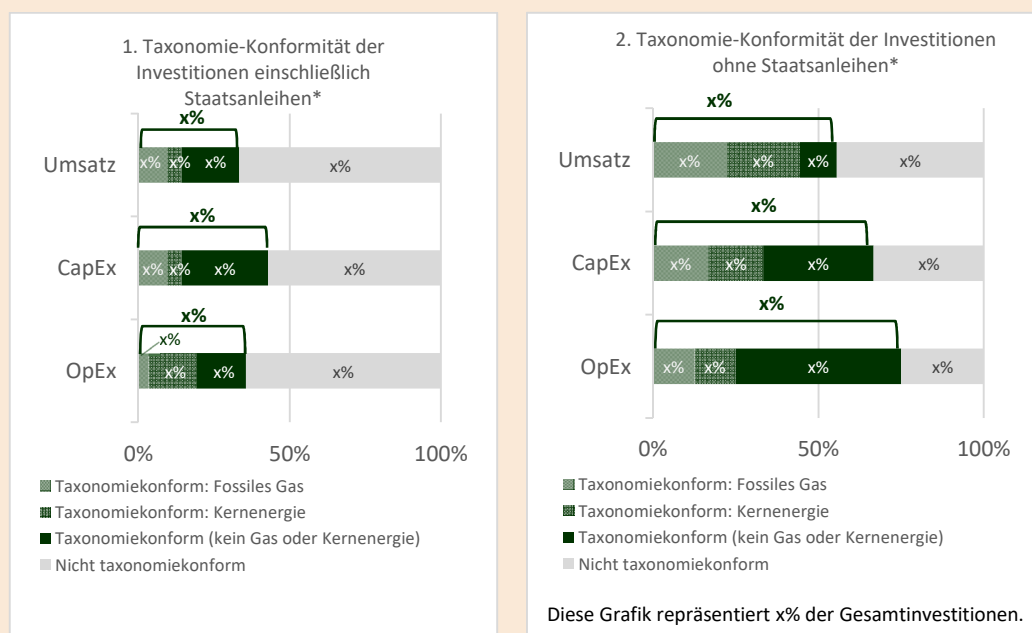
Nein

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**


Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

27,77 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

20,13 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (das „Portfolio“).

**Unternehmenskennung:** 549300IFJK0FPOE1X496

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es <b>wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 58,24 %* an nachhaltigen Investitionen  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel  <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei der Verwirklichung der UN-Ziele einer nachhaltigen Entwicklung (Sustainable Development Goals, „**SDGs**“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarben und bewerben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen.<sup>1</sup> Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).



Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Das Portfolio hat nicht in Emittenten investiert, die im Hinblick auf den NB-ESG-Quotienten im unteren Quartil rangieren.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	56	97 %
Daten von Dritten	4,8	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindeststrategie des NB-ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten aus dem Anlageuniversum aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Hersteller von Pelz, Glücksspielunternehmen und im Bereich Kernkraft tätige Unternehmen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDGs“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens haben der Manager und der Sub-Investment-Manager Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigten, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager trugen bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „staatlichen PAIs“) für die staatlichen Emittenten. THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Emittenten, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen sowie Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (für Unternehmensemittenten, zusammen die „PAIs“).

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

#### *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

#### *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio verpflichtete sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
2. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, nämlich: Die staatlichen PAIs für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PANAMA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,5 %	Panama
PERU THE REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,2 %	Peru
INDONESIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,5 %	Indonesien
CHILE GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,6 %	Chile
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,4 %	Mexiko
INDONESIA REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,3 %	Indonesien
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,9 %	Mexiko
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,9 %	Mexiko
ROMANIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,8 %	Rumänien
KAZAKHSTAN GOVERNMENT BOND MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,7 %	Kasachstan
BERMUDA (GOVERNMENT OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,5 %	Bermuda
BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPP RegS	U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,4 %	Supranational
PHILIPPINES REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	Philippinen
URUGUAY GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Uruguay
INDONESIA REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Indonesien

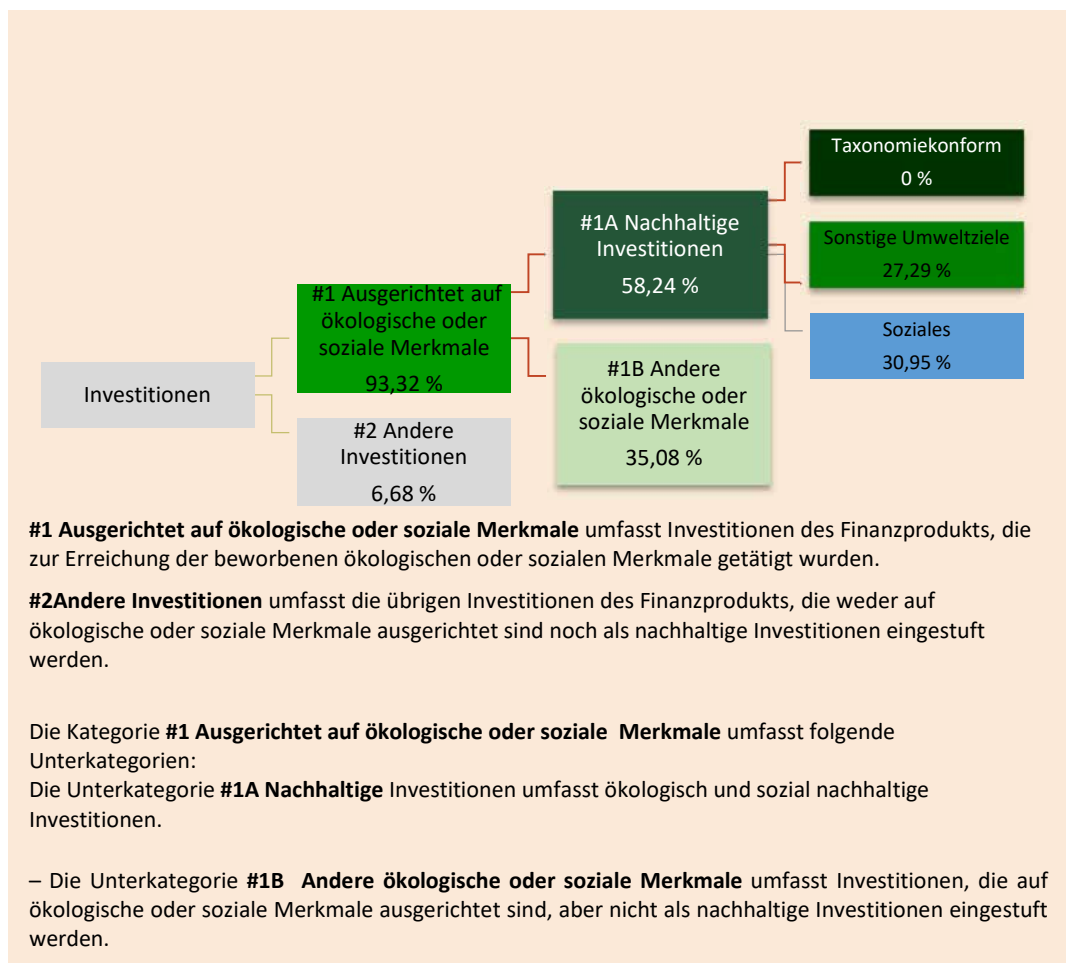


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,83 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,05 %
D – Energieversorgung	0,32 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,76 %
H - Verkehr und Lagerei	1,73 %
J – Information und Kommunikation	1,02 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	7,11 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	82,76 %
U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	2,06 %
Keine	0,36 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

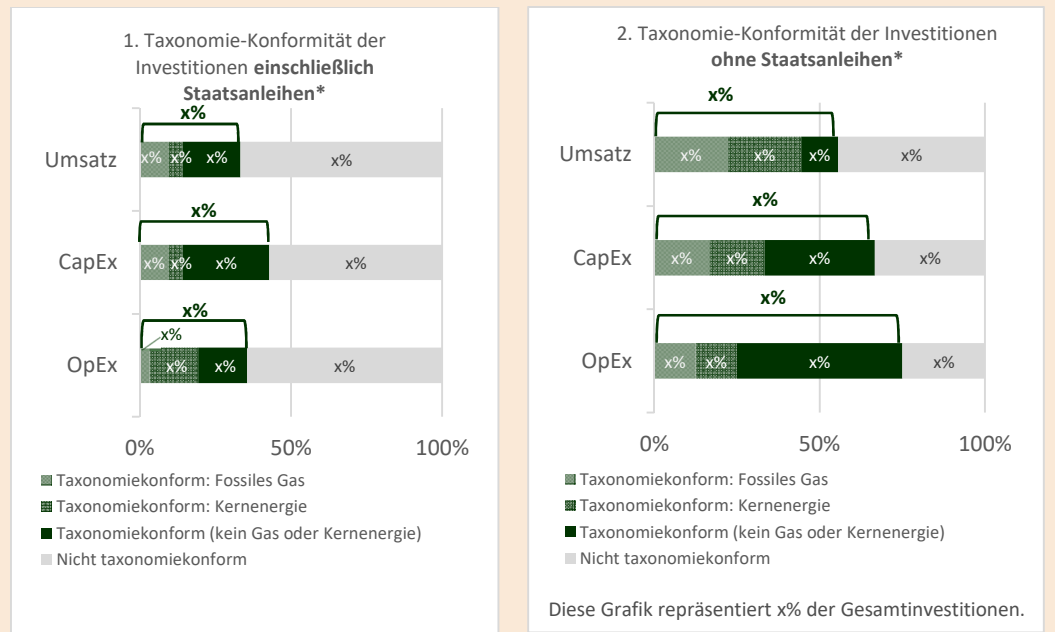
● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?

- Ja:
- In fossiles Gas                       In Kernenergie
- Nein

Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonmie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonmie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonmie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonmie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

27,29 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

30,95 %



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Das Portfolio hat nicht in Emittenten investiert, die im Hinblick auf den NB-ESG-Quotienten im unteren Quartil rangierten.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493005FAT85HZ73DG37

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

<b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<p><input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 59.95 %* an nachhaltigen Investitionen.</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p style="margin-left: 20px;"><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p style="margin-left: 20px;"><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b></p>

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („THG“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

Im dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager künftig die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.<sup>1</sup> Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Das Portfolio erreichte ein Niveau der reduzierten CO<sub>2</sub>-Emissionen, die um mindestens 30 % niedriger war als das des breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen, das durch den JPMorgan Asian Credit High Yield Index (der „Index“) repräsentiert wird. Die durchschnittliche CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität wurde auf der Grundlage der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität des Portfolios gemessen und berechnet. Sie wurde an jedem der vier Kalenderquartalsenden im Bezugszeitraum 2022 ermittelt. Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Index abzubilden. Er wird hier zu Vergleichszwecken für die Reduzierung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität und von aufgenommen.

Zum 31. Dezember 2022 hat das Portfolio, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters, eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen erreicht, das durch den Index repräsentiert wird.

- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

---

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden.

Der Sub-Investment-Manager schloss Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating aus, es sei denn, es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotient-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	55	95 %
Daten von Dritten	5,5	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

### 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus wurden Emittenten ausgeschlossen, die direkt in Kinderarbeit und die Tabakindustrie involviert waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörtere und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten hat der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDGs“).

Bei staatlichen Emittenten hat der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Die Berücksichtigung Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens hat der Sub-Investment-Manager Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigten, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „staatlichen PAIs“) für die staatlichen Emittenten. THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Emittenten, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, sowie Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (für Unternehmensemittenten, zusammen die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 hat der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.



— — —  
*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 hat der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
2. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, nämlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
GREENKO POWER II LIMITED RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,1 %	Indien
SANDS CHINA LTD	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	4,0 %	Macau
MEDCO BELL PTE LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,7 %	Indonesien
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,3 %	China
MELCO RESORTS FINANCE LTD RegS	R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,2 %	Macau
CAS CAPITAL NO 1 LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,1 %	Hongkong
GLOBE TELECOM INC RegS	J – Information und Kommunikation	2,1 %	Philippinen
KASIKORNBANK PCL MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,0 %	Thailand
STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WIND RegS	D – Energieversorgung	2,0 %	Indonesien
CONTINUUM ENERGY LEVANTER PTE LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,0 %	Indien
ADANI GREEN ENERGY UP LTD RegS	D – Energieversorgung	1,9 %	Indien
NETWORK I2I LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,8 %	Indien
PERIAMA HOLDINGS LLC	F – Baugewerbe/Bau	1,8 %	Indien
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,8 %	Indonesien
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	F – Baugewerbe/Bau	1,7 %	China

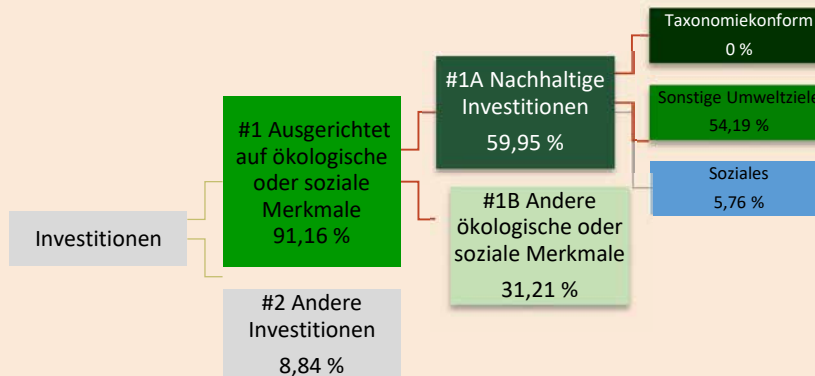


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,84 %
D – Energieversorgung	10,46 %
F – Baugewerbe/Bau	10,10 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,82 %
H - Verkehr und Lagerei	1,28 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	11,17 %
J – Information und Kommunikation	4,31 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	47,02 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	2,01 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,13 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,85 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	5,03 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

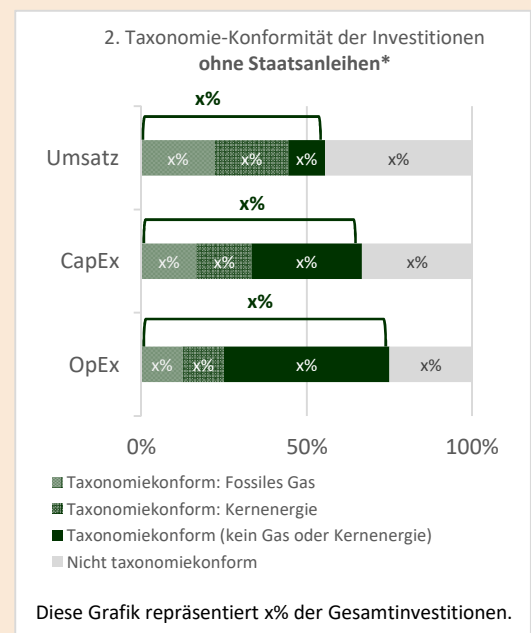
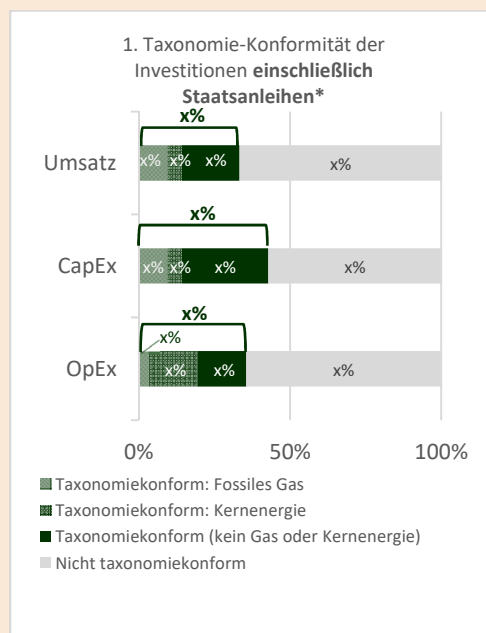
Nein

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

54,19 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

5,76 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine wichtige Komponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Der Sub-Investment-Manager schloss Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating aus, es sei denn, es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotient-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.





### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9, Absätze 1 bis 4a, der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300OWRIKGBWGY0X93

## Nachhaltiges Investitionsziel

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: **42,09 %**

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: **51,23 %**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



## Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das Portfolio investierte in Wertpapiere von Emittenten, die zu ökologischen und sozialen Zielen beitragen. Die Emittenten wurden gegenüber dem nachhaltigen Anlageziel anhand der nachstehend aufgeführten Parameter bewertet.

### Ökologische Ziele

Der Sub-Investment-Manager hat gezielt in Emittenten investiert, die nachweislich bessere Fortschritte bei der Anpassung und der Eindämmung des Klimawandels, der Reduzierung von Treibhausgasemissionen („THG“) und der Ausrichtung auf das Netto-Null-Ziel gemacht haben.

#### Ziele staatlicher Emittenten:

Länder, die sich im obersten 25 %-Perzentil befinden oder im nächsten 25 %-Perzentil mit sich verbessernden Eigenschaften in Bezug auf den Indikator des staatlichen Klimaübergangsrisiko (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf die Minderung des Klimarisikos, die Anpassung an den Klimawandel, die THG-Emissionen und die Anpassung an das Netto-Null-Ziel konzentrieren), wurden als in Einklang mit dem Umweltziel betrachtet.

Die Netto-Null-Verpflichtungen und -Ziele wurden in der Erwartung festgelegt, dass die Regierungen ihre eigenen Verpflichtungen einhalten, um sicherzustellen, dass die Ziele des Pariser Abkommens erreicht werden, einschließlich erhöhter Ambitionen ihrer national festgelegten Beiträge (Nationally Determined Contributions, „NDCs“).

#### Ziele unternehmerischer Emittenten:

Der Sub-Investment-Manager beabsichtigt, den CO<sub>2</sub>-Fußabdruck des Portfolios für Wertpapiere von Unternehmen in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen zu reduzieren, was einer Verringerung um 50 % bis 2030 im Vergleich zu einem als Basiswert angenommenen Jahr (2019) und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 entspricht. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen.<sup>1</sup> Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf den Meilenstein 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

### Soziale Ziele

Der Sub-Investment-Manager zielte auf Investitionen in Emittenten ab, die bessere Fortschritte bei der Erreichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“), mit einem Schwerpunkt auf den Bereichen öffentliche Gesundheit und Bildung, nachweisen konnten.

Länder, die sich im obersten 25 %-Perzentil befinden oder im nächsten 25 %-Perzentil mit sich verbessernden Eigenschaften in Bezug auf den Indikator für staatliche Nachhaltigkeit (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf Lebenserwartung, Bildung und die breiteren Fortschritte bei der Erreichung der SDGs konzentrieren), wurden als in Einklang mit dem sozialen Ziel betrachtet.

Das Portfolio hat sein nachhaltiges Anlageziel erreicht. Die Performance bzgl. des nachhaltigen Anlageziels wurde anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

---

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die Erreichung der nachhaltigen Anlageziele des Portfolios zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### i. **Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten:**

Der Sub-Investment-Manager nutzte die folgenden Berichte, Indizes und Bewertungen von Dritten, um die Fortschritte des Portfolios bei der Erreichung seiner nachhaltigen Anlageziele für Staaten zu messen:

#### **Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz:**

- Notre Dame Global Adaptation Initiative Country Index („**ND-GAIN**“)

Der Sub-Investment-Manager verwendete den ND-GAIN-Index, um die Anfälligkeit eines Landes für den Klimawandel und die Klimaübergangsrisiken zu messen und zu bewerten.

Der Sub-Investment-Manager konzentrierte sich bei seiner Bewertung auf die einkommensbereinigte Anpassung an den Klimawandel.

- THG-Emissionen von Staaten:

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die territorialen THG-Emissionen von Staaten, definiert als Tonnen CO<sub>2</sub>-Emissionen pro investierter Mio. USD. CO<sub>2</sub>-Emissionen werden dem Portfolio auf der Grundlage des Anteils der Brutto-Gesamtverschuldung der Länder zugerechnet, der vom Portfolio gehalten wird. Emittenten mit der höchsten gewichteten Kohlenstoffintensität – definiert als unteres Quartil und zunehmend – wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen. Dies erlaubte es dem Sub-Investment-Manager, die Fortschritte bei der Reduzierung der Emissionen pro BIP zu messen.

- Anpassung an das Netto-Null-Ziel – GermanWatch's Climate Change Performance Index („**CCPI**“) und Climate Action Tracker

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die Anpassung an das Netto-Null-Ziel von Ländern, die Staatsanleihen begeben gemäß dem CCPI und dem vom Climate Action Tracker gemessenen nationalen und globalen Bemühungen zur Eindämmung der globalen Erwärmung. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, Länder anzuvisieren, die sich bis 2050 oder früher zu Netto-Null-Emissionen verpflichtet haben.

#### **Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung, Bildung und Kaufkraftparitätseinkommen:**

- Sustainable Development Report Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte die Bertelsmann Stiftung und den Sustainable Development Solutions Network Sustainable Development Report Index, um die Leistung von Ländern bzgl. der SDGs zu bewerten. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte bei der Verwirklichung der SDGs demonstrierten.

- UNDP Human Development Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte den UNDP-Index für menschliche Entwicklung, um die Errungenschaften in den Schlüsselbereichen Lebenserwartung und Bildung weltweit zu messen. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte für die menschliche Entwicklung demonstrierten.

Die oben aufgeführten Berichte und Bewertungen unabhängiger Dritter (namentlich ND-GAIN, CCPI, Sustainable Development Report Index und UNDP Human Development Index) wurden zusammengefasst, um „Top-Performers“ (Länder im obersten 25 %-Perzentil, die mit den ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios übereinstimmen) oder „Top-Improvers“ (Länder im nächsthöheren 25 %-Perzentil, die sich verbessern und an die staatlichen ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios angepasst waren und weiterhin anpassen) zu identifizieren.

Nachfolgend finden Sie eine Übersicht über die gesamte Liste der staatlichen Emittenten aus Schwellenländern, die den ökologischen und/oder sozialen Ziele des Portfolios entsprachen und als Top-Performer oder Top-Improver eingestuft wurden.

Alle staatlichen Emittenten aus Schwellenländern, die im Portfolio gehalten werden, wurden als Top-Performer oder Top-Improver eingestuft. Die Einstufung von Ländern als Top-Performer oder Top-Improver ist ein Indikator dafür, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Ziele für Staaten erfüllt.

Ländername	Kombinierter Indikator für ökologische Nachhaltigkeit		Kombinierter Indikator für soziale Nachhaltigkeit		SFDR-Klassifikation (E/S)	SFDR-Klassifikation
	Top Performer	Top Improver	Top Performer	Top Improver		
Albanien	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Argentinien			x		Soziales	Nachhaltig
Armenien	x			x	Umwelt	Nachhaltig
Bahrain			x		Soziales	Nachhaltig
Barbados			x		Soziales	Nachhaltig
Bosnien-Herzegowina			x		Soziales	Nachhaltig
Botswana		x			Umwelt	Nachhaltig
Brasilien				x	Soziales	Nachhaltig
Bulgarien			x		Soziales	Nachhaltig
Chile	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Kolumbien				x	Soziales	Nachhaltig
Costa Rica	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Elfenbeinküste				x	Soziales	Nachhaltig
Kroatien	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Dominikanische Republik				x	Soziales	Nachhaltig
Ecuador			x		Soziales	Nachhaltig
El Salvador	x				Umwelt	Nachhaltig
Fidschi	x			x	Umwelt	Nachhaltig
Georgien	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Ghana	x				Umwelt	Nachhaltig
Ungarn			x		Soziales	Nachhaltig
Jamaika		x			Umwelt	Nachhaltig
Jordanien	x			x	Umwelt	Nachhaltig
Kasachstan			x		Soziales	Nachhaltig
Malediven		x			Umwelt	Nachhaltig
Mauritius	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Mexiko				x	Soziales	Nachhaltig
Moldawien	x				Umwelt	Nachhaltig
Montenegro	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Marokko	x				Umwelt	Nachhaltig
Nordmakedonien	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Oman		x	x		Umwelt	Nachhaltig
Panama		x			Umwelt	Nachhaltig
Peru		x	x		Umwelt	Nachhaltig
Philippinen		x			Umwelt	Nachhaltig
Polen			x		Soziales	Nachhaltig
Rumänien			x		Soziales	Nachhaltig
Ruanda		x			Umwelt	Nachhaltig
Serbien			x		Soziales	Nachhaltig
Sri Lanka			x		Soziales	Nachhaltig
Thailand			x		Soziales	Nachhaltig
Tunesien	x				Umwelt	Nachhaltig
Türkei			x		Soziales	Nachhaltig
Ukraine			x		Soziales	Nachhaltig
Vereinigte Arabische Emirate			x		Soziales	Nachhaltig
Uruguay	x		x		Umwelt	Nachhaltig
Usbekistan		x			Umwelt	Nachhaltig

## ii. **ESG-Ausschlusspolitik:**

Zur Sicherstellung, dass die nachhaltigen Anlageziele des Portfolios erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy oder die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren.

Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Der Sub-Investment-Manager schloss ebenfalls Wertpapiere von Unternehmensemittenten aus dem Anlageuniversum aus, die in kontroverse Aktivitäten und Verhaltensweisen verwickelt waren, sowie solche Unternehmensemittenten, die hinsichtlich des NB-ESG-Quotienten<sup>2</sup> am schlechtesten bewertet wurden.

Darüber hinaus schloss der Sub-Investment-Manager staatliche Emittenten aus, deren Menschenrechtssituation sich verschlechtert hat und deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat wegen Menschenrechtsverletzungen sanktioniert wurden, oder andere staatliche Emittenten, deren THG-Intensität als hoch erachtet wird und zunimmt, oder staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht eingehalten haben, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („FATF“) als Hochrisikoland eingestuft wurden.

Mindestens 20 % des Anlageuniversums wurden aus diesen Gründen ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

---

<sup>2</sup> Der NB- ESG-Quotient ist ein hausinternes ESG-Ratingsystem von NB, das auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten basiert und ein ESG-Gesamtrating für Emittenten erstellt, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens hat der Sub-Investment-Manager Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachen würde, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung. Bei staatlichen Emittenten (die den Großteil des Portfolios ausmachen) waren dies: THG-Intensität und Länder, in die investiert wird, in denen es zu sozialen Verstößen kommt; und bei staatlichen Emittenten waren dies: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Emittenten, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen sowie Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (zusammen die „**PAIs**“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 hat der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung von Emittenten, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben aufgeführten detaillierten NB-ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

— — —  
*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 hat der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy identifiziert wurden.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Sub-Investment-Manager prüfte die Auswirkungen der PAIs auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

In Bezug auf das Portfolio erfolgte die Betrachtung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevante PAI festgelegt wurden, unterschritten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben aufgeführten detaillierten NB-ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.





## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts** entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

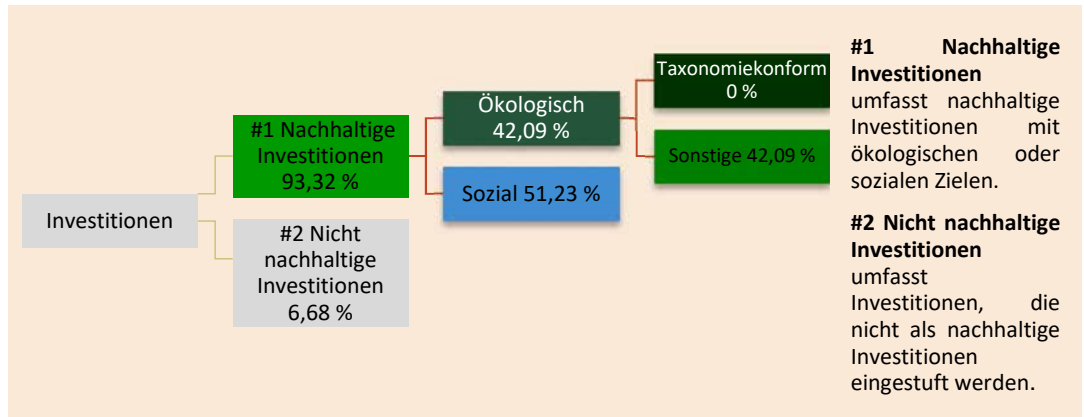
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
CHILE (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,4 %	Chile
COSTA RICA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,4 %	Costa Rica
OMAN GOVERNMENT BOND MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,1 %	Oman
ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,9 %	Argentinien
REPUBLIC OF PERU	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,6 %	Peru
UZBEKISTAN (REPUBLIC OF) MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,5 %	Uszbekistan
COLOMBIA REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,4 %	Kolumbien
REPUBLIC OF ARMENIA RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,2 %	Armenien
COTE D IVOIRE REPUBLIC OF RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,2 %	Elfenbeinküste
OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,0 %	Oman
DOMINICAN REPUBLIC (GOVERNMENT) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,9 %	Dominikanische Republik
ECUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,8 %	Ecuador
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,8 %	Mexiko
DOMINICAN REPUBLIC RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,7 %	Dominikanische Republik
MOROCCO (KINGDOM OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,7 %	Marokko



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Taxonomie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,95 %
H - Verkehr und Lagerei	1,01 %
J – Information und Kommunikation	0,13 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,85 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	90,93 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,91 %
Keine	3,22 %



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>3</sup>?

Ja:

In

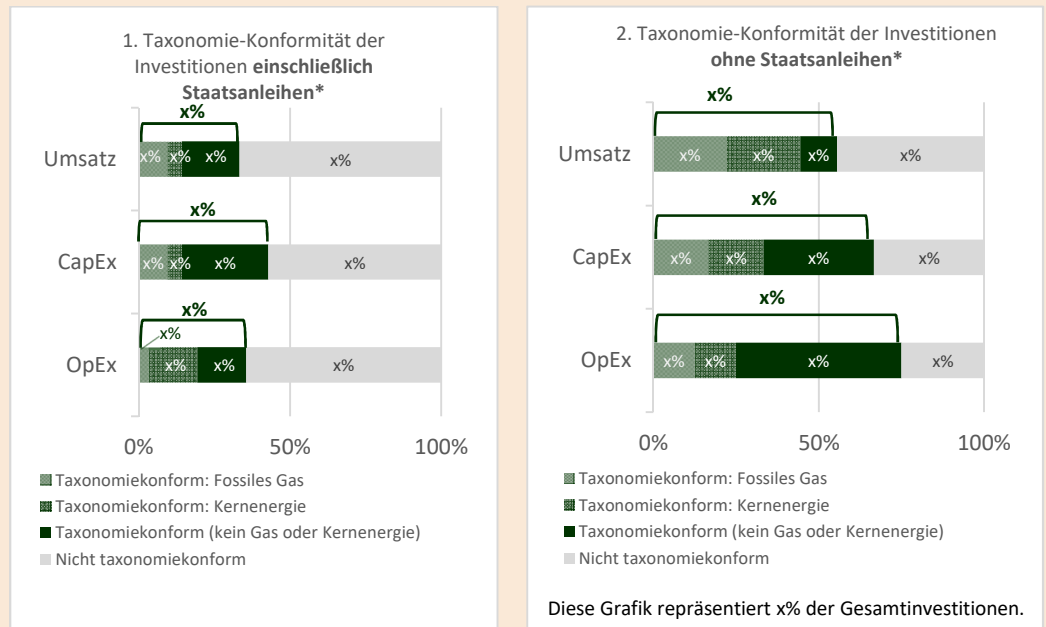
fossiles

Gas In Kernenergie

Nein

<sup>3</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

42,09 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Anlagen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Anlagen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



sind ökologisch nachhaltige Investitionen, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

51,23 %



## Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die sich nicht als nachhaltige Investitionen qualifizierten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Sub-Investment-Manager als notwendig für das ordnungsgemäße Funktionieren des Portfolios erachtete, z. B. die Gewährleistung einer angemessenen Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine nachhaltigen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem nachhaltigen Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### i. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Indikator für die Entwicklung der Nachhaltigkeit von Staaten (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers) bewertete die Fortschritte staatlicher Emittenten bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz, der Verringerung der THG-Emissionen und der Ausrichtung auf Netto-Null sowie bei der Erreichung der SDGs mit besonderem Schwerpunkt auf der öffentlichen Gesundheit und Bildung.

Der Sub-Investment-Manager führte zudem eine fortlaufende Analyse der ESG-Faktoren durch, indem er emittentenbezogene Bewertungen des NB-ESG-Quotienten erstellte und nutzte, um Risiken und Chancen bei der Gesamtbewertung der Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings konnten auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden nicht in das Portfolio aufgenommen.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	53	97 %
Daten von Dritten	4,3	

Für den NB-ESG-Quotient wird ein Rating zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche ESG-Rating ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Der Sub-Investment-Manager tätigte keine Investitionen in staatlichen Emittenten, bei denen er eine schwache ESG-Praxis festgestellt hat. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden;
- Staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem Referenzwert ausgeschlossen wurden;

- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden;
- Staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende THG-Emissionsintensität festgestellt wurde;
- Staatliche Emittenten, bei denen schlechte und sich verschlechternde Kennzahlen für Menschenrechte und Rechtsstaatlichkeit festgestellt wurden; und
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der FATF als Hochrisikoland eingestuft wurden.

**ii. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

**ii. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass das vom Portfolio beworbene nachhaltige Anlageziel erreicht wurde, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher ist es nicht mit den nachhaltigen Zielen des Portfolios vereinbar.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.



---

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

---

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman China Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300I3S2HFIMB3V932

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („THG“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	50	67 %
Daten von Dritten	4,4	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindesttrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

#### 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Ab dem 19. August 2022 baute das Portfolio sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbot Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 19. August 2022 verbot das Portfolio außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD - Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BANK OF CHINA LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	6,7 %	China
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	6,6 %	China
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	D – Energieversorgung	4,5 %	China
BRIGHT FOOD (GROUP) CO LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,5 %	China
GUANGZHOU YUEXIU HOLDING LTD MTN	F – Baugewerbe/Bau	4,5 %	China
SHENZHEN METRO GROUP CO LTD	H – Verkehr und Lagerei	4,5 %	China
CENTRAL HUIJIN INVESTMENT LTD MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,5 %	China
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,4 %	China
BOC AVIATION (USA) CORPORATION MTN RegS	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,9 %	Singapur
CHINA HONGQIAO GROUP LIMITED RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	China
GUANGZHOU METRO INVESTMENT FINANCE MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,7 %	China
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,3 %	China
CHINA POST GROUP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	China
CHINA RESOURCES CO LTD MTN	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,2 %	China
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,2 %	China

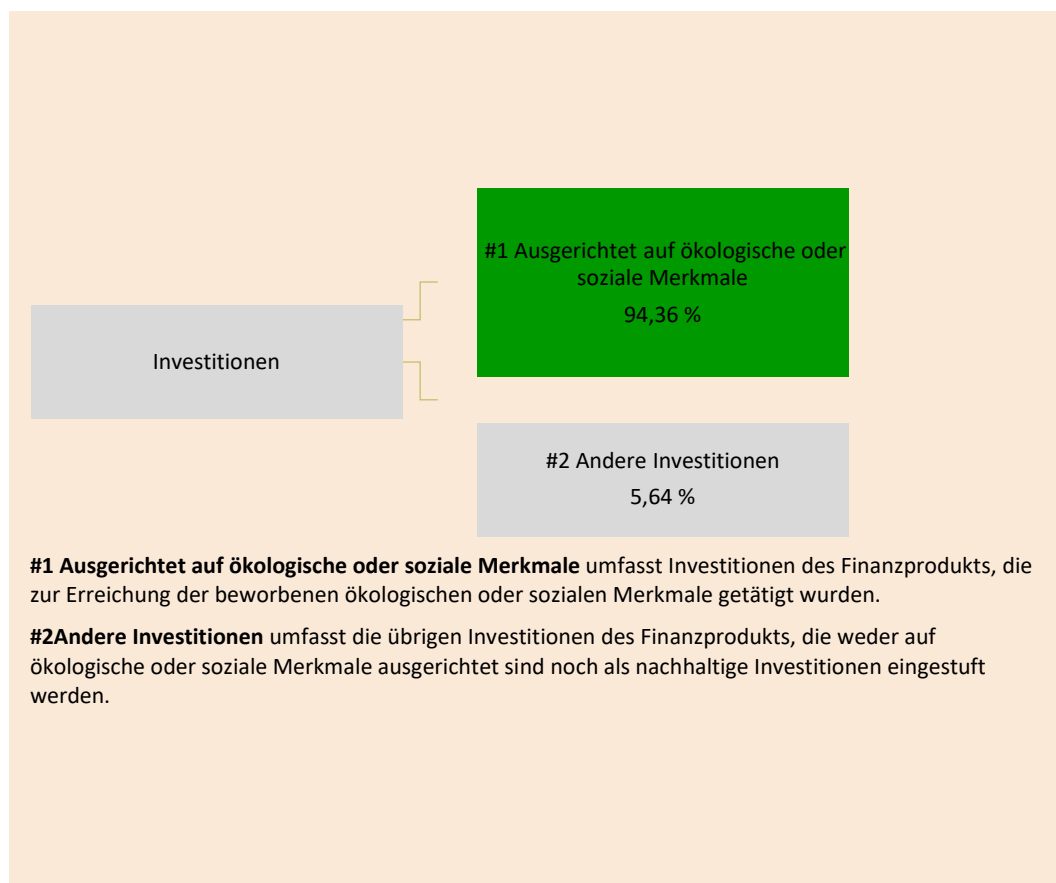


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der ökologisch und/oder sozial ausgerichteten Portfolioanlagen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,7 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	13,1 %
D – Energieversorgung	7,5 %
F – Baugewerbe/Bau	5,6 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,8 %
H - Verkehr und Lagerei	7,6 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	33,5 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	5,6 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	16,7 %
Keine	6,8 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für

**Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

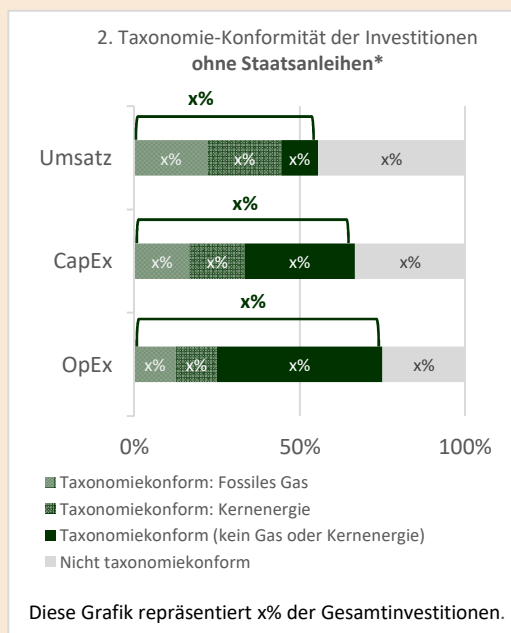
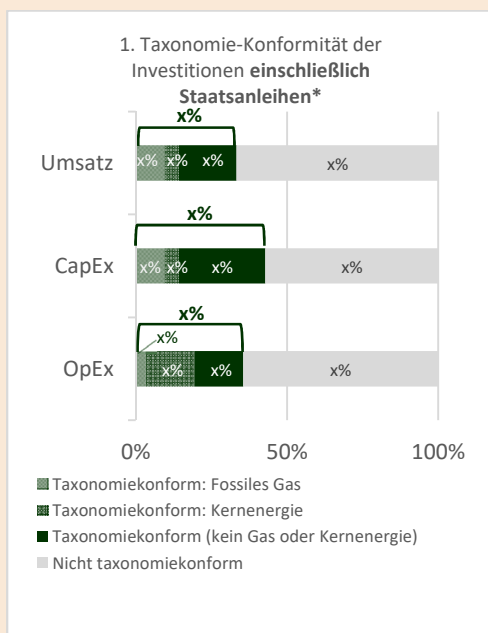
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman High Yield Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300IJY8N43QRUU802

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und  obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel  <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks\*, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	57	99 %
Daten von Dritten	5,0	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

### 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**“) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandels pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 11,99 % führen könnte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 57 %.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen werden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD - Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem

### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum. Emittenten stützten.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

k. A.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch hat der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerei	1,2 %	USA
LEVEL 3 FINANCING INC 144A	K - Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	USA
GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO LTD 144A	N - Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,0 %	Cayman Islands
CSC HOLDINGS LLC 144A	J - Information und Kommunikation	0,9 %	USA
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerei	0,8 %	USA
ONEMAIN FINANCE CORP	K - Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	USA
NB GLOBAL MONTHLY INCOME FUND LTD	K - Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Guernsey, Channel Islands
ALLIANT HOLDINGS INTERMEDIATE LLC 144A	K - Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	USA
CCO HOLDINGS LLC 144A	J - Information und Kommunikation	0,8 %	USA
REALOGY GROUP LLC / REALOGY CO ISS 144A	L - Grundstücks- und Wohnungswesen	0,7 %	USA
NEW FORTRESS ENERGY INC 144A	D - Energieversorgung	0,7 %	USA
MOZART DEBT MERGER SUB INC 144A	K - Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,7 %	USA
HARVEST MIDSTREAM I LP 144A	H - Verkehr und Lagerei	0,7 %	USA
PAREXEL 2L TL-B 7/21 Pvt	N - Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,6 %	USA
REALOGY GROUP LLC 144A	L - Grundstücks- und Wohnungswesen	0,6 %	USA

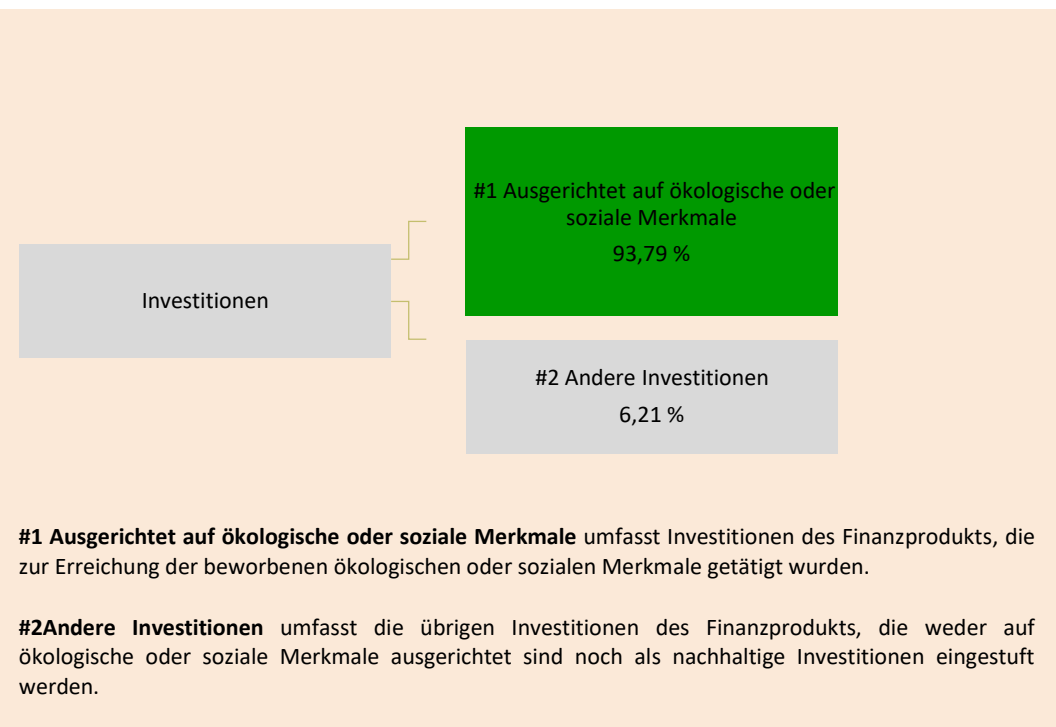


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	7,76 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	11,86 %
D – Energieversorgung	4,32 %
F – Baugewerbe/Bau	1,57 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,10 %
H – Verkehr und Lagerei	10,75 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,46 %
J – Information und Kommunikation	15,88 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	19,32 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,55 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,73 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	10,24 %
P – Erziehung und Unterricht	0,04 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,48 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,48 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,35 %
Keine	4,08 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.



**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

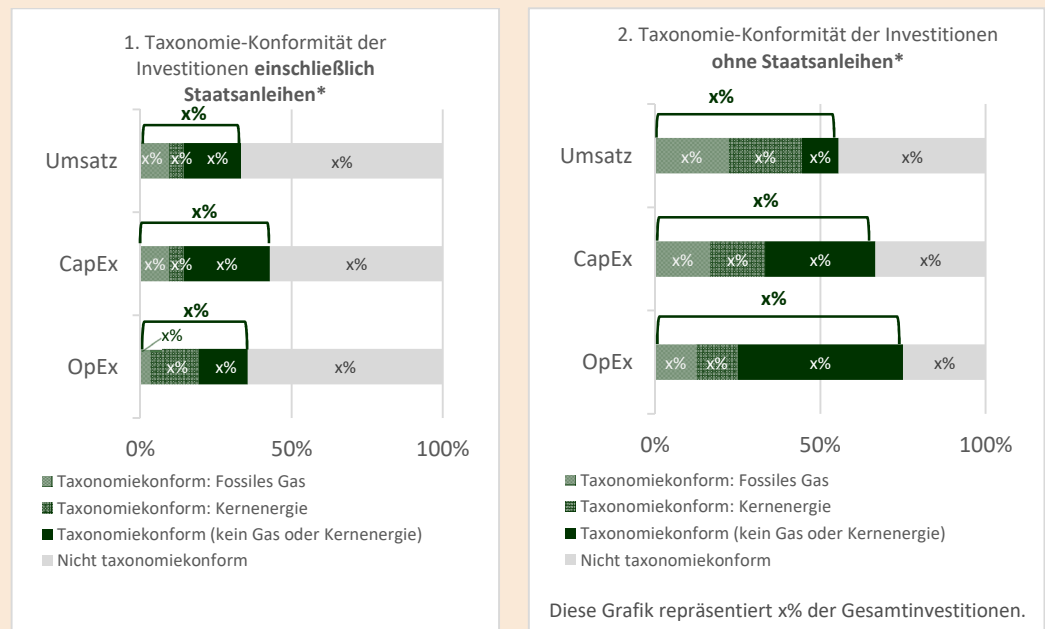
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.



**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493009EN8Z7034TFP15

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks\*, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

Um das Portfolio auf ein Null-Nettoziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in den Scope-1-, Scope-2- und wesentlichen Scope-3-THG-Emissionen<sup>1</sup>. Damit soll das Ziel des Portfolios erreicht werden, bis 2030 eine Verringerung um 50 % im Vergleich zu einem als Basiswert angenommenen Jahr (2019) und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 erreicht werden. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Der Sub-Investment-Manager hielt ein durchschnittliches ESG-Rating für das Portfolio aufrecht, das besser war als das des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird und der auf der Grundlage von ESG-Ratings Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde. Diese Berechnung basierte auf dem ESG-Rating des Portfolios zum Ende eines jeden der vier Kalenderquartale im Bezugszeitraum 2022. Das Portfolio wurde aktiv verwaltet, der ICE BofA U.S. High Yield Index wurde ausschließlich zum Vergleich von ESG-Ratings und der Reduzierung der Kohlenstoffintensität verwendet.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB, die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analytenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, einen konstruktiven Dialog mit 90 % der Unternehmensemittenten Vorrang zu priorisieren.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	57	100 %
Daten von Dritten	5,3	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Der Sub-Investment-Manager hat nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme beigefügt. Die nachstehenden Daten beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022.

Der Sub-Investment-Manager trat 2022 mit 114 im Portfolio gehaltenen Unternehmen in Kontakt.
65 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch).
48 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt.
14 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternehmen abgedeckt.
16 % der Unternehmen, mit denen im Bezugszeitraum 2022 zusammengearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.

Weitere Informationen zu den Bemühungen des Sub-Investment-Managers für die Zusammenarbeit finden Sie hier [https://www.nb.com/handlers/documents.ashx?item\\_id=454c682e-ea4b-4406-af2f-b6ef65c2ef00](https://www.nb.com/handlers/documents.ashx?item_id=454c682e-ea4b-4406-af2f-b6ef65c2ef00)

3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“CVaR”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandels pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 12,37 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 60 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

#### 4. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Das Portfolio hat Emittenten ausgeschlossen, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Hersteller von Pelz, Glücksspielunternehmen und im Bereich Kernkraft tätige Unternehmen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k. A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H – Transport und Lagerung	1,9 %	USA
APX GROUP INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,5 %	USA
IRON MOUNTAIN INC 144A	L – Immobilienaktivitäten	1,4 %	USA
GENESIS ENERGY LP	C – Fertigung	1,4 %	USA
SUNNOVA ENERGY CORP 144A	D – Energieversorgung	1,3 %	USA
PERFORMANCE FOOD GROUP INC 144A	G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,3 %	USA
GARDA WORLD SECURITY CORP 144A	N – Verwaltungs- und Unterstützungsdienstleistungen	1,1 %	Kanada
BUCKEYE PARTNERS LP	H – Transport und Lagerung	1,0 %	USA
ASSURED PARTNERS INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA
ALLIANT HOLDINGS INTERMEDIATE LLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA
BANIJAY ENTERTAINMENT SAS 144A	J – Information und Kommunikation	1,0 %	Frankreich
CSC HOLDINGS LLC	J – Information und Kommunikation	0,9 %	USA
TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Niederlande

ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP 144A  
XHR LP 144A

H – Transport und Lagerung  
L – Immobilienaktivitäten

0,9 %  
0,9 %

USA  
USA

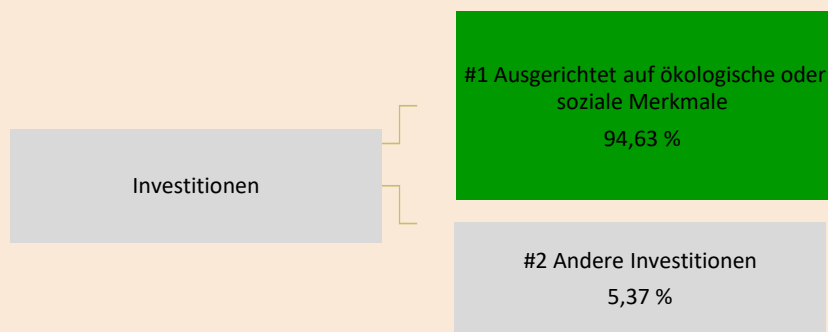


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Steine & Erden	5,36 %
C – Fertigung	14,09 %
D – Energieversorgung	3,45 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	1,01 %
F – Baugewerbe/Bau	1,80 %
G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,84 %
H – Transport und Lagerung	10,98 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,39 %
J – Information und Kommunikation	13,48 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	19,09 %
L – Immobilienaktivitäten	5,14 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,60 %
N – Verwaltungs- und Unterstützungsdienstleistungen	8,47 %
P – Erziehung und Unterricht	0,00 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,86 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,70 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,15 %
Keine	4,60 %





Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

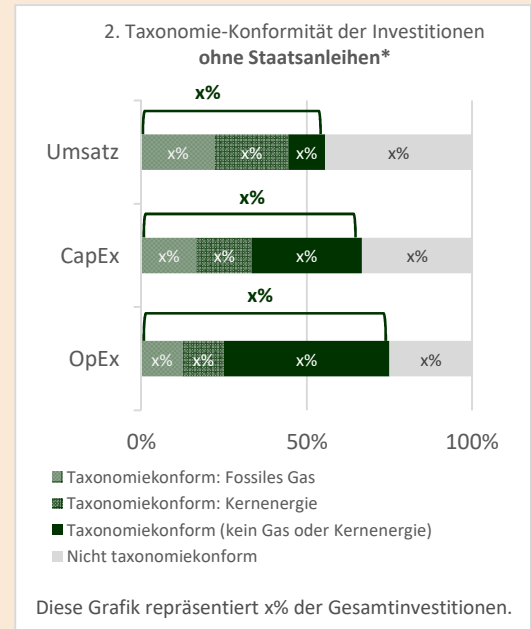
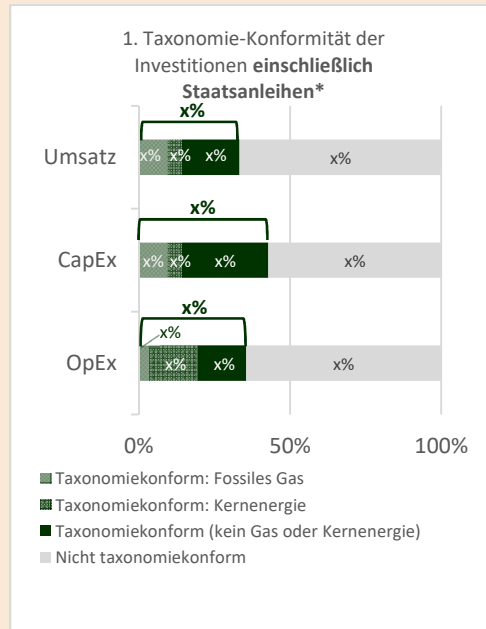
Nein

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden aus dem Portfolio entfernt.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung erfasst und überwacht (weitere Einzelheiten sind dem obigen Abschnitt über die Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio:

- Beitrag zur Verwirklichung der SDGs, indem mit mindestens 90 % der Emittenten Kontakt aufgenommen und Maßnahmen besprochen wurden, die sie im Rahmen ihrer Produkte, Dienstleistungen, betrieblichen Abläufe oder Prozesse ergreifen könnten und die mit diesen Zielen in Einklang stehen (oder wo das Potenzial besteht, dass nach einer Zusammenarbeit mit diesen Emittenten eine stärkere Ausrichtung auf diese Ziele erreicht wird).
- Hielt ein durchschnittliches ESG-Rating für das Portfolio aufrecht, das besser war als das des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE

BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird und der auf der Grundlage von ESG-Ratings Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde. Diese Berechnung basierte auf dem ESG-Rating des Portfolios zum Ende eines jeden der vier Kalenderquartalen im Bezugszeitraum 2022.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine systematische Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager priorisierte Anlagen in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator zwischen „2“ und „5“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
-

---

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300Z7RL5FC5H5DB41

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks\*, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analytistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	59	98 %
Daten von Dritten	5,5	



Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 8,73 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 34 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Dem Portfolio war es nicht gestattet, Wertpapiere von Emittenten zu kaufen, die erhebliche Einnahmen aus der Kohleförderung erzielten oder unkonventionelle Methoden zur Förderung von Öl und Gas einsetzten. Erhebliche Einnahmen wurden zu diesem Zweck wie folgt definiert: (i) Emittenten durften nicht mehr als 10 % der Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen; (ii)

Emittenten durften nicht mehr als 10 % der Einnahmen aus der Olsandgewinnung erzielen. Das Portfolio kaufte Wertpapiere von Emittenten, bei denen die Stromerzeugung mehr als 10 % der Einnahmen ausmachte nur dann, wenn die Emittenten auf eine Wirtschaft mit geringeren CO<sub>2</sub>-Emissionen ausgerichtet sind.

Es war dem Portfolio daher untersagt, in Stromerzeuger zu investieren, die: (i) mehr als 30 % der MWh-Erzeugung aus Kraftwerkskohle generierten; (ii) mehr als 30 % der MWh-Erzeugung aus flüssigen Brennstoffen (Öl) bezogen und (iii) Strom aus Erdgas erzeugten. Mehr als 90 % der MWh-Erzeugung wurde aus Erdgas gewonnen. Dieser Schwellenwert kann im Laufe der Zeit sinken, um einen schrittweisen Übergang zu einem höheren Anteil an erneuerbaren Energien zu ermöglichen.

Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Das Portfolio durfte keine Wertpapiere von Emittenten kaufen, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten. Dem Portfolio war ebenfalls der Kauf von Wertpapieren von Emittenten untersagt, die private Gefängnisse besaßen, betrieben oder überwiegend integrale Dienstleistungen für diese erbrachten. Die Gründe sind die erheblichen sozialen Kontroversen, die Reputationsrisiken, die Abhängigkeit von der Politik der lokalen Regierung und der Umstand, dass diese Einrichtungen nicht ohne weiteres für andere Zwecke umgestaltet werden können. Dem Portfolio war es untersagt, Wertpapiere von Emittenten zu kaufen, die an der Herstellung von zivilen Feuerwaffen beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

k. A.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

k. A.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel**: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS	D – Energieversorgung	1,2 %	Frankreich
SGL CARBON SE RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,2 %	Deutschland
CELLNEX TELECOM SA MTN RegS	J – Information und Kommunikation	1,1 %	Spanien
ADIANT GLOBAL HOLDINGS LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	USA
ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS	D – Energieversorgung	1,1 %	Frankreich
REPSOL INTL FINANCE RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Spanien
ALTICE FRANCE SA (FRANCE) RegS	J – Information und Kommunikation	1,1 %	Luxemburg
VERISURE HOLDING AB RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,1 %	Schweden
LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS	J – Information und Kommunikation	1,1 %	Spanien
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,0 %	Deutschland
ILIAD HOLDING SAS RegS	J – Information und Kommunikation	1,0 %	Frankreich
THYSSENKRUPP AG RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,0 %	Deutschland
SUMMIT PROPERTIES LTD RegS	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,0 %	Deutschland
PLAYTECH PLC RegS	R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,0 %	Großbritannien
CMA CGM SA RegS	H – Verkehr und Lagerei	0,9 %	Frankreich

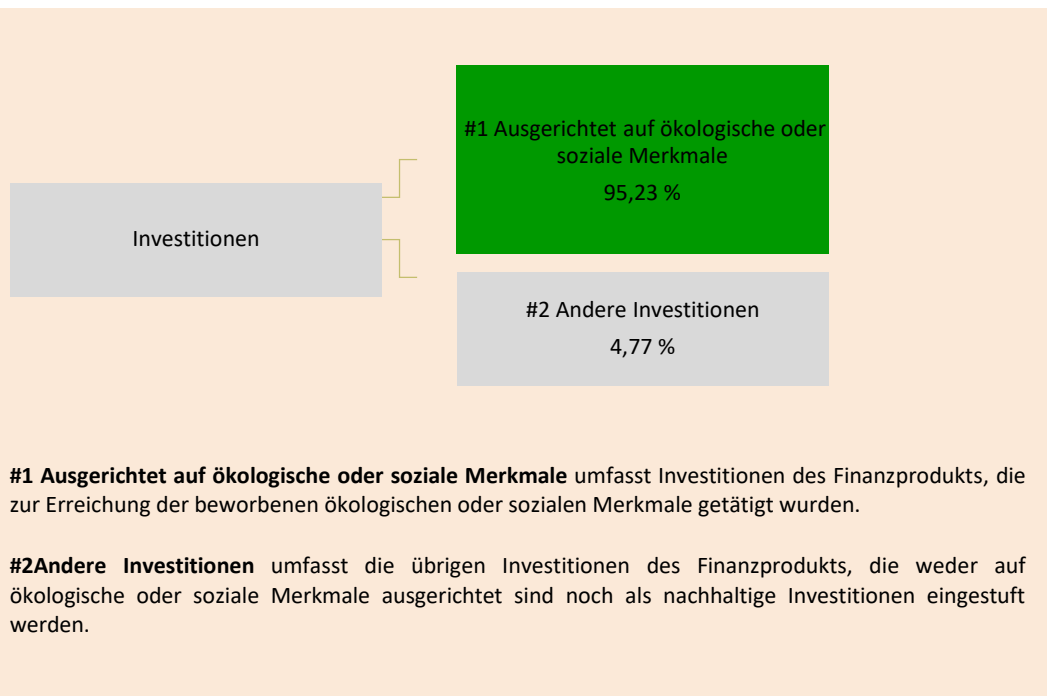


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der ökologisch und/oder sozial ausgerichteten Portfolioanlagen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Die Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basiert für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.





### ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	25,20 %
D – Energieversorgung	3,19 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,55 %
F – Baugewerbe/Bau	0,48 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,46 %
H – Verkehr und Lagerei	3,06 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,70 %
J – Information und Kommunikation	13,35 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	34,50 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,80 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,44 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	6,02 %
P – Erziehung und Unterricht	0,37 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,48 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,23 %
Keine	1,17 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Nicht zutreffend – Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Als solches betrug der Mindestanteil der Portfolioanlagen, die zu ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten für die Zwecke der Taxonomie-Verordnung beitragen, 0 %. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden.

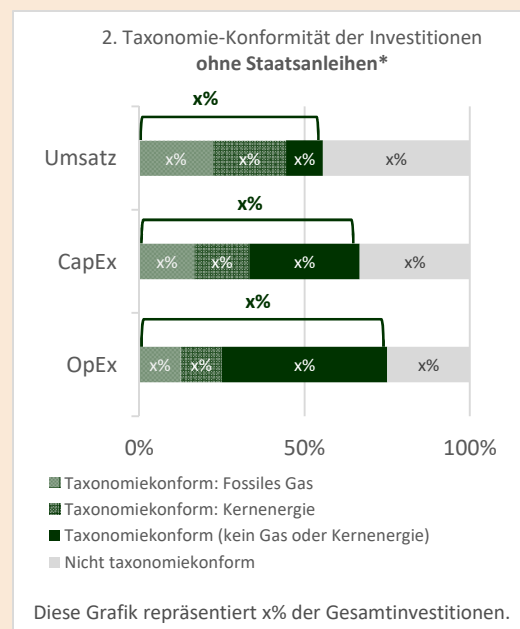
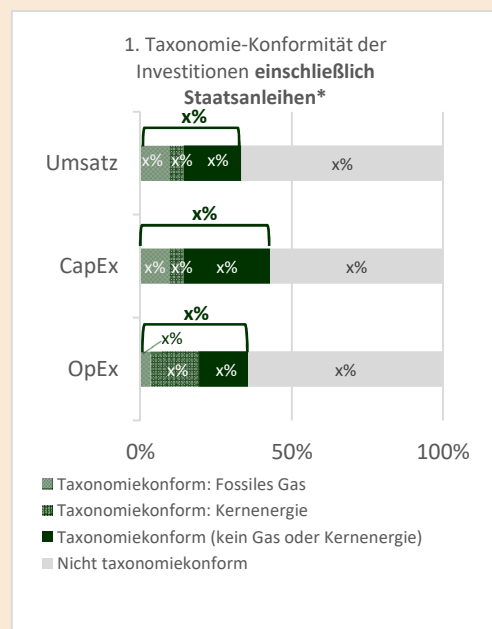
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

Taxoniekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.





sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Finanzprodukts (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in

überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhindern und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300YE6BLJU5JCD113

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

<b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>	
<span style="color: green;">● ●</span> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<span style="color: green;">●</span> <span style="color: grey;">●</span> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%  <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> in                      Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> in                      Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und  obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.  <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <div style="margin-left: 20px;"> <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel                 </div> <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Das Portfolio bewarb die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“), indem es direkt mit 100 % der Unternehmensemittenten zusammenarbeitete. Der Sub-Investment-Manager hat Leistungskennzahlen („KPIs“) für Unternehmensemittenten festgelegt, die auf die SDGs ausgerichtet waren und sich auf die Produkte, Dienstleistungen, betriebliche Tätigkeiten oder Prozesse der Emittenten bezogen, mit dem Ziel, ein positives Ergebnis für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu erzielen. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks\*, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, einen konstruktiven Dialog mit 100 % der Unternehmensemittenten Vorrang zu priorisieren.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	68	100 %
Daten von Dritten	5,6	

Für den NB-ESG-Quotient wird ein Rating zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Der Sub-Investment-Manager hat nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme beigefügt. Die nachstehenden Daten beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022.

Der Sub-Investment-Manager trat 2022 mit 207 im Portfolio gehaltenen Unternehmen in Kontakt.
61 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch).
50 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt.
15 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternehmen abgedeckt.
20 % der Unternehmen, mit denen im Bezugszeitraum 2022 zusammengearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.

Weitere Informationen zu den Bemühungen des Sub-Investment-Managers für die Zusammenarbeit finden Sie hier: [https://www.nb.com/handlers/documents.ashx?item\\_id=4f53e43f-6a45-4977-be2f-1bb942b05536](https://www.nb.com/handlers/documents.ashx?item_id=4f53e43f-6a45-4977-be2f-1bb942b05536).

## 3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandels pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 9,05 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 53 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

#### 4. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ab dem 6. April 2022 durfte das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten kaufen, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

#### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

#### ● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO2-Fußabdruck, THG-



Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 144A	H - Verkehr und Lagerei	0,7 %	USA
ASCENT RESOURCES/ARU FIN 144A	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,7 %	USA
SOLARIS MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A	H - Verkehr und Lagerei	0,7 %	USA
CCO HOLDINGS LLC 144A	J – Information und Kommunikation	0,6 %	USA
GTCR AP FINANCE INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	USA
IRON MOUNTAIN INC 144A	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,6 %	USA
MOZART DEBT MERGER SUB INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	USA
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	USA
TRANSDIGM INC 144A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,6 %	USA
SUNNOVA ENERGY CORP 144A	D – Energieversorgung	0,6 %	USA
SENSATA TECHNOLOGIES BV 144A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,6 %	USA
PRIME SECURITY SERVICES BORROWER L 144A	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,6 %	USA
CSC HOLDINGS LLC 144A	J – Information und Kommunikation	0,6 %	USA
LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS	J – Information und Kommunikation	0,5 %	Spanien
CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 144A	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,5 %	USA

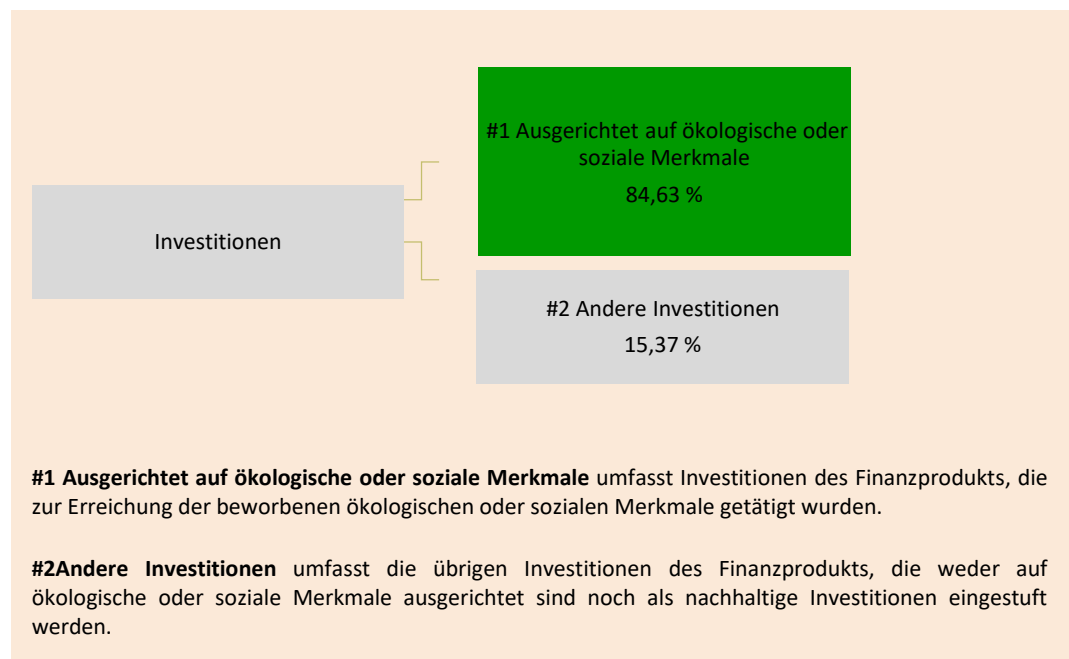


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	4,61 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	16,84 %
D – Energieversorgung	3,48 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,50 %
F – Baugewerbe/Bau	2,58 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,78 %
H – Verkehr und Lagerei	6,65 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,22 %
J – Information und Kommunikation	13,13 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	28,35 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,09 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,20 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	6,62 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,22 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,92 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,24 %
Keine	1,56 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätig-keiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alter-nativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In

fossiles

Gas In Kernenergie

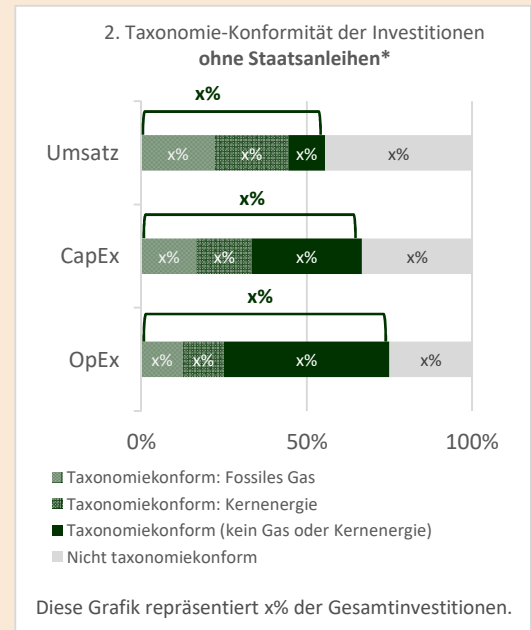
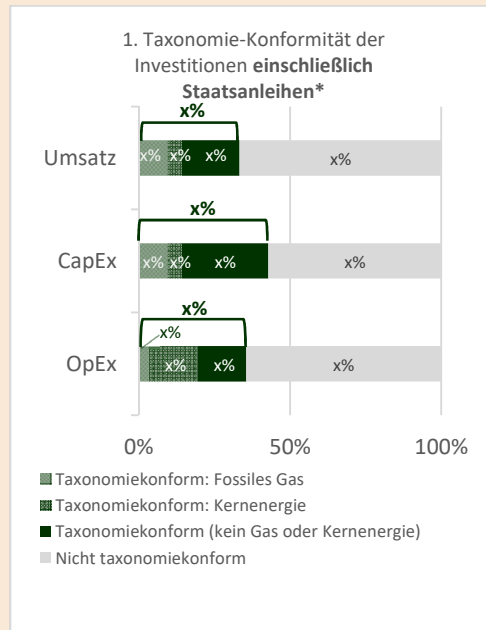
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung überwacht und nachvollzogen (weitere Einzelheiten sind dem obigen Berichtsabschnitt zur Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio bewarb ökologische und soziale Merkmale. Zugleich leistete es einen Beitrag zur Erreichung der SDGs, indem direkt mit allen Unternehmensemittenten zusammengearbeitet wurde. Die Mitwirkung erfolgte über persönliche Treffen und Gespräche sowie durch Festlegung von wesentlichen Leistungsindikatoren (KPIs), die auf die SDGs ausgerichtet sind und auf die Produkte, Dienstleistungen, den Geschäftsbetrieb oder die Prozesse der Emittenten Bezug nahmen. Damit sollte ein positives Ergebnis bezogen auf die Umwelt und/oder Gesellschaft erzielt werden. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen. Der Sub-Investment-Manager beurteilte vierteljährlich die Fortschritte der im Portfolio vertretenen Emittenten gegenüber den festgelegten KPIs. Diese direkte Mitwirkung bei Unternehmensemittenten war wesentlicher Bestandteil des Anlageprozesses und ausschlaggebend für den Portfoliobeitrag zur Erreichung der SDGs.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der

Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine systematische Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von weniger als „2“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



#### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
-



---

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300J4GX5K2889LG47

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
Ja	Nein
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 51,21 % an nachhaltigen Investitionen* <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Im Zuge der Leitlinien der Europäischen Kommission zur Einstufung von Portfolios gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 („**SFDR**“) wurde das Portfolio am 19. August 2022 von einem Artikel-9-Portfolio in ein Artikel-8-Portfolio umgestuft. Diese regelmäßige Offenlegung wurde daher auf Basis der Anforderungen erstellt, die für ein Artikel-8-Portfolio gemäß SFDR gelten.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks\*, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

\*In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.<sup>1</sup> Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Darüber hinaus verwendete der Sub-Investment-Manager den ICE BofA Global High Yield Constrained Index ausschließlich zum Vergleich von ESG-Ratings und zur Reduzierung der Kohlenstoffintensität. Der Sub-Investment-Manager hielt ein durchschnittliches ESG-Rating für das Portfolio aufrecht, das besser war als das des breiten globalen Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA Global High Yield Constrained Index repräsentiert wird und der auf der Grundlage von ESG-Ratings Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### i. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analytistentteams für das Portfolio genutzt wurde.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	61	100 %
Daten von Dritten	6,1	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

ii. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 4,30 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 62 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

iii. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Hersteller von Pelz, Glücksspielunternehmen und im Bereich Kernenergie tätige Unternehmen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Hielten die Emittenten dieser Bewertung stand, wurden sie vom Sub-Investment-

Manager einer weiteren Bewertung zu ihrem ökologischen oder sozialen Beitrag zur Wirtschaft unterzogen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens hat der Sub-Investment-Manager Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: TH-Emissionen; CO<sub>2</sub>-Fußabdruck; THG-Emissionsintensität der Emittenten, in die investiert wird; Anteil der Investitionen in Emittenten mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe; Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen; Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren; Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken; Emissionen in Wasser; Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle; Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen; fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen; unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle; Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen; und Beteiligungen an umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 hat der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 hat der Sub-Investment-Manager in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
2. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, nämlich: THG-Emissionen, CO2-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
IRON MOUNTAIN INC RegS	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,8 %	USA
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP RegS	J – Information und Kommunikation	1,6 %	USA
PRIME SECURITY SERVICES BORROWER L RegS	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,6 %	USA
ONEMAIN FINANCE CORP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,5 %	USA
ALBERTSONS COMPANIES INC RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,5 %	USA
VALVOLINE INC RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,4 %	USA
ASSUREDPARTNERS INC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,4 %	USA
HCA INC	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,3 %	USA
SGL CARBON SE RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,2 %	Deutschland
VMED O2 UK FINANCING II PLC RegS	k. A.	1,2 %	Großbritannien
TENET HEALTHCARE CORPORATION RegS	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,2 %	USA
TERRAFORM POWER OPERATING LLC RegS	D – Energieversorgung	1,2 %	USA
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,2 %	Kanada
ORGANON FINANCE 1 LLC RegS	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,2 %	USA
GYP HOLDINGS III CORP RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,2 %	USA



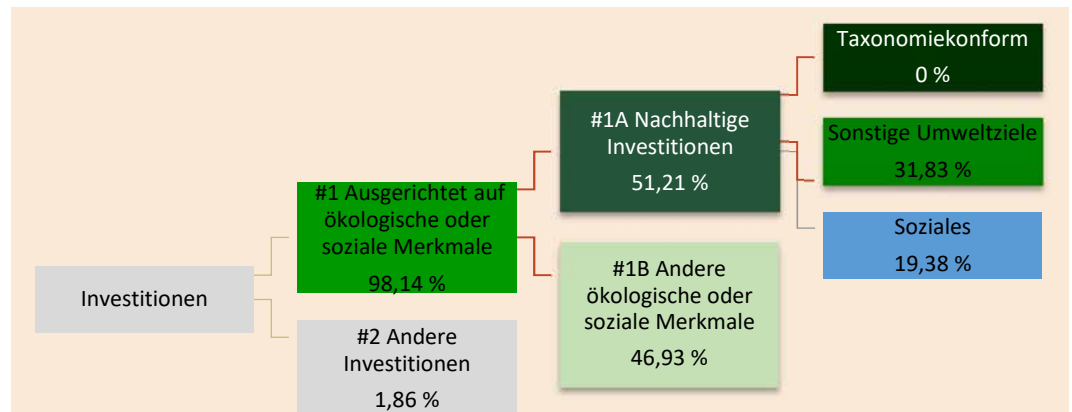


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basiert für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

**Zum 31. Dezember 2022**

<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,67 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	18,50 %
D – Energieversorgung	3,84 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,13 %
F – Baugewerbe/Bau	1,73 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	10,48 %
H – Verkehr und Lagerei	1,72 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,30 %
J – Information und Kommunikation	9,12 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	31,95 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,94 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,62 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	5,90 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	6,03 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,17 %
Keine	2,89 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätig-keiten** sind Tätig-keiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alter-nativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

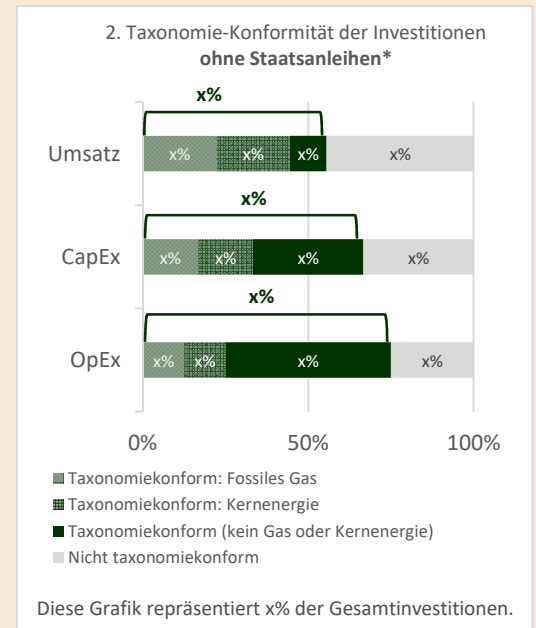
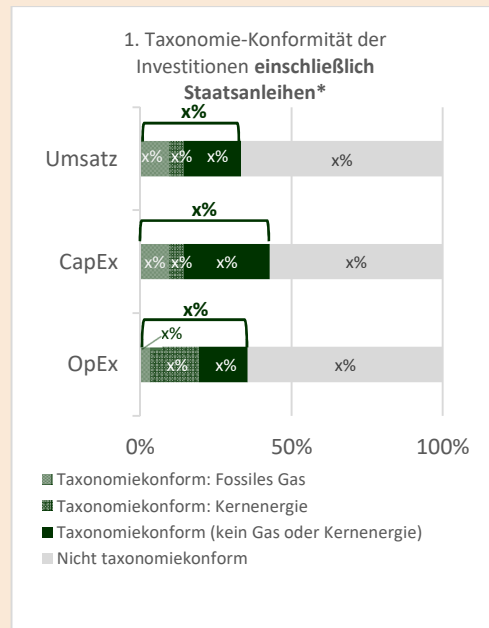
Nein

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

31,83 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

19,38 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

i. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

ii. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

iii. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300RDJHEJZZ6XVX05

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	68	77 %
Daten von Dritten	6,5	

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 1,70 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 24 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagten der Manager und der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig waren und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— — **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— — **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“) für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
CANADA (GOVERNMENT OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,3 %	Kanada
CANADA (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,6 %	Kanada
KOREA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,5 %	Korea (South), Republic of
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,3 %	USA
JAPAN (GOVERNMENT OF) 5YR #149	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,3 %	Japan
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,1 %	Mexiko
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	USA
UK I/L GILT RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Großbritannien
KOREA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,2 %	Korea (South), Republic of
JAPAN (GOVERNMENT OF) 30YR #61	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	Japan
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,0 %	Deutschland
STACR 22-HQA1 M1A 144A	k. A.	0,9 %	USA
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,9 %	Indonesien
UMBS 30YR TBA(REG A)	k. A.	0,9 %	USA
TREASURY NOTE (20LD)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,8 %	USA

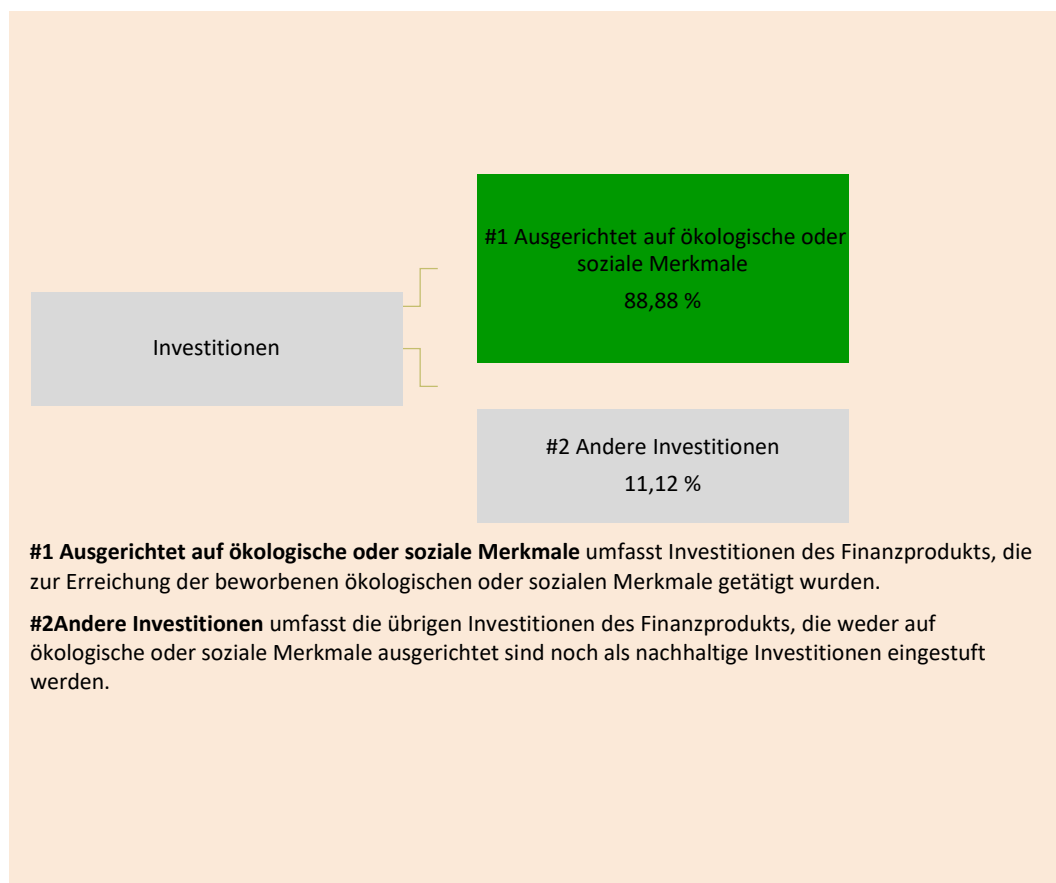


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,63 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,96 %
D – Energieversorgung	1,60 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,08 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,50 %
H - Verkehr und Lagerei	0,37 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,36 %
J – Information und Kommunikation	4,98 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	18,08 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,02 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,22 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	40,21 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,44 %
U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	2,44 %
Keine	23,12 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

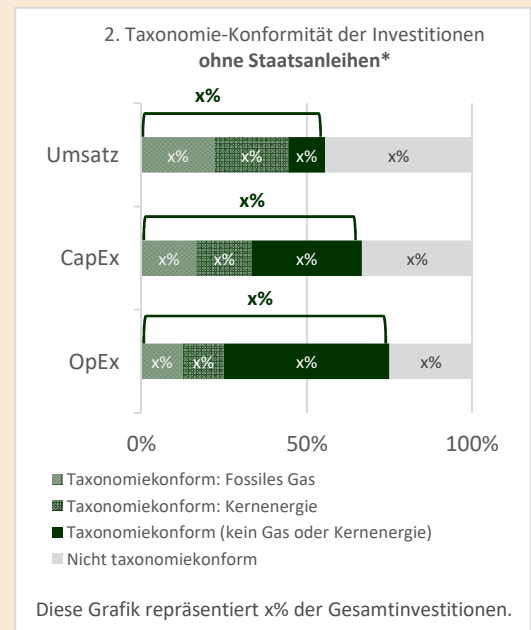
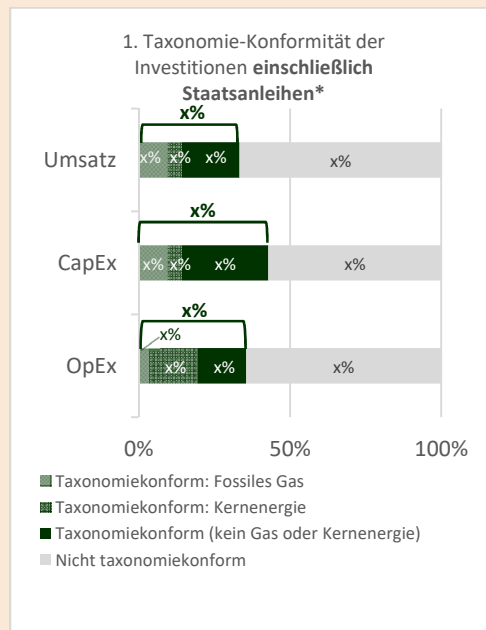
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.





## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced“ [„TBA“] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300ZNNZZYDVTNRE14

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	61	80 %
Daten von Dritten	5,7	

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 4,18 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 24 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagten der Manager und der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig waren und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— — **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— — **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio hat sich nicht dazu verpflichtet, nachhaltige Investitionen zu halten, doch haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager ab dem 6. April 2022 in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“) für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.





## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NEW ZEALAND (GOVERNMENT OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,5 %	Neuseeland
NB GLOB INV GRADE CR USD Z	k. A.	2,3 %	Irland
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,0 %	China
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,9 %	Mexiko
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k. A.	1,6 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k. A.	1,5 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	USA
UMBS 30YR TBA	k. A.	1,3 %	USA
UMBS 30YR TBA	k. A.	1,1 %	USA
STACR 18-HQA1 M2	k. A.	1,1 %	USA
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	China
UMBS 30YR TBA(REG A)	k. A.	1,0 %	USA
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,9 %	China
NGG FINANCE PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Großbritannien

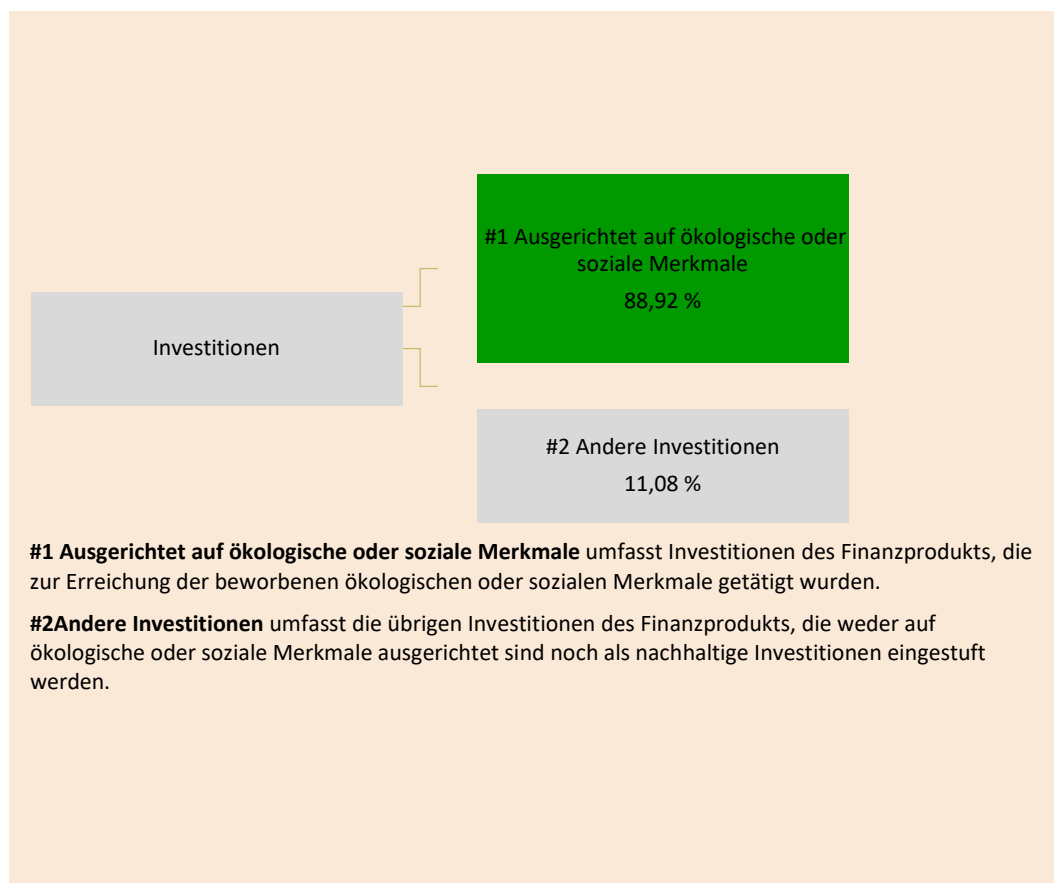


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,36 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	10,49 %
D – Energieversorgung	1,26 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,24 %
F – Baugewerbe/Bau	0,24 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,71 %
H – Verkehr und Lagerei	2,14 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,45 %
J – Information und Kommunikation	5,72 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	20,77 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,62 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,18 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,53 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	31,56 %
P – Erziehung und Unterricht	0,12 %

Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,26 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,52 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,00 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,35 %
Keine	19,50 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

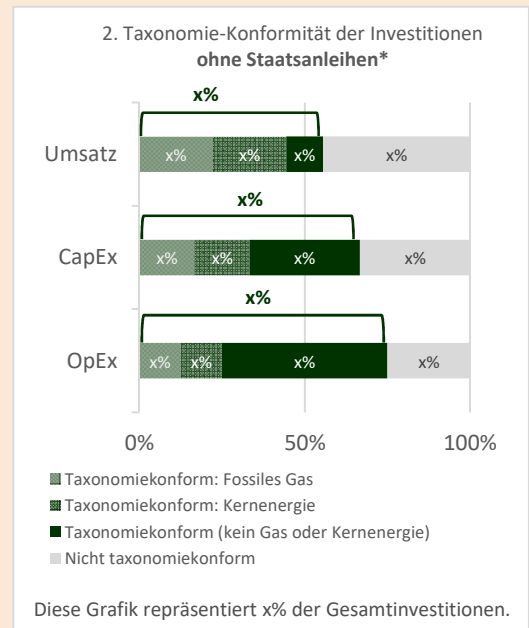
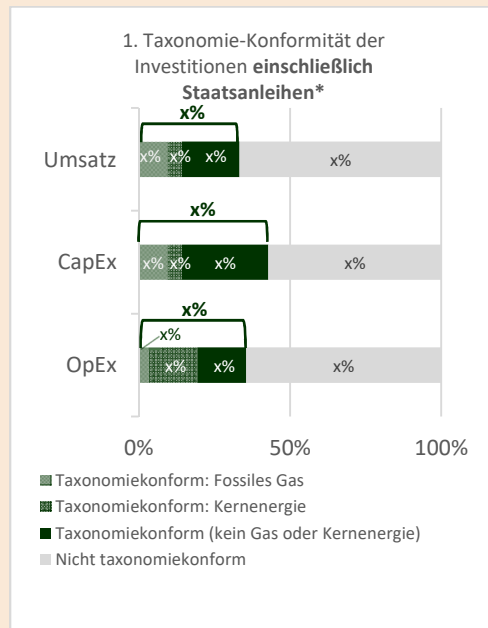
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced“ [„TBA“] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Strategic Income Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300RBLDK0PHH13M43

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hauseigene Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam des Portfolio-Analyistenteam genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	72	66 %
Daten von Dritten	5,7	

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 10,17 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 33 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig waren und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“) für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	5,4 %	USA
UMBS 30YR TBA	k. A.	3,4 %	USA
UMBS 30YR TBA	k. A.	2,8 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k. A.	2,6 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k. A.	2,6 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k. A.	2,5 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,9 %	USA
GNMA2 30YR TBA(REG C)	k. A.	1,8 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	USA
GNMA2 30YR TBA(REG C)	k. A.	1,4 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	USA
NB GLOB INV GRADE CR USD Z	k. A.	1,3 %	Irland
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,2 %	USA
NB CHINA BD FUND USD ZA UNHEDGED	k. A.	0,9 %	Irland

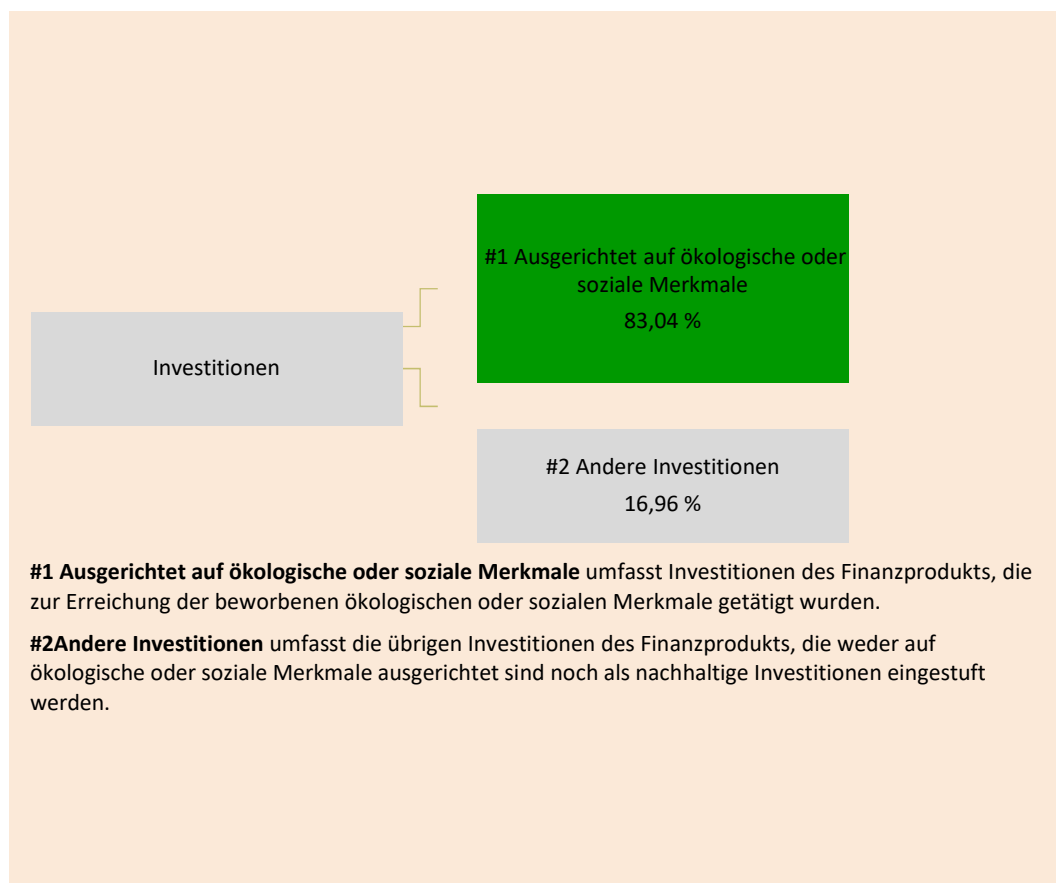


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	0,02 %
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,26 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	7,17 %
D – Energieversorgung	2,51 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,02 %
F – Baugewerbe/Bau	0,29 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,18 %
H – Verkehr und Lagerei	3,89 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,34 %
J – Information und Kommunikation	6,32 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	17,90 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,81 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,13 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,32 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	17,58 %

P – Erziehung und Unterricht	0,06 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,84 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,66 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,11 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,02 %
Keine	34,56 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

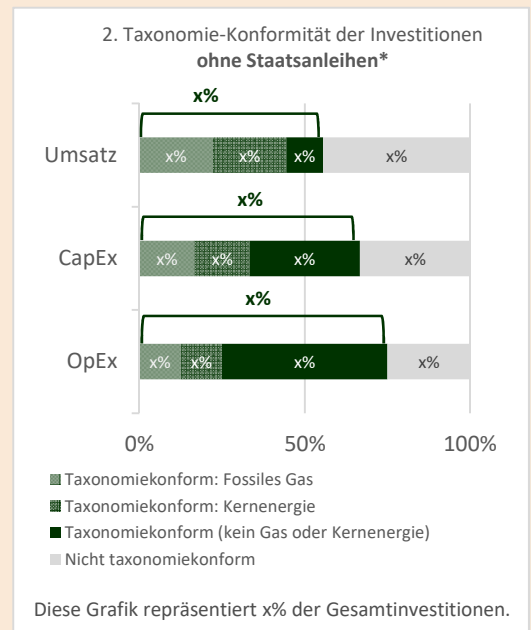
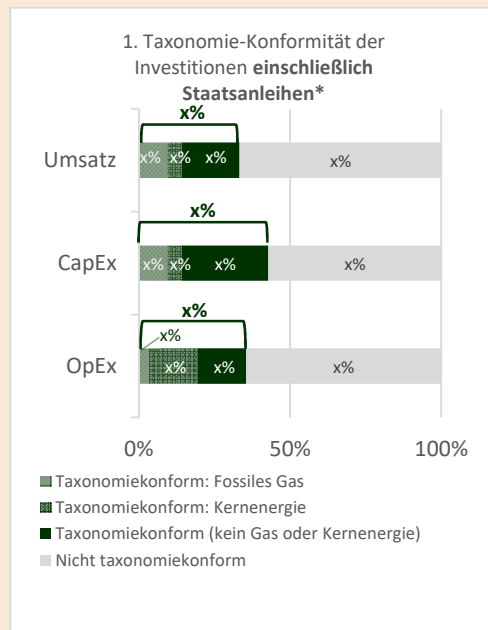
- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.





## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced“ [„TBA“]) oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind, die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300TMYI9EFR4Q1G47

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	58	96 %
Daten von Dritten	6,9	

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 5,22 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügt. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 41 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapiere von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.





## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NGG FINANCE PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	7,0 %	Großbritannien
ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS	D – Energieversorgung	5,2 %	Frankreich
SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO	D – Energieversorgung	4,9 %	USA
BAYER AG RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,4 %	Deutschland
VODAFONE GROUP PLC \$60NC6 MTN RegS	J – Information und Kommunikation	3,8 %	Großbritannien
CENTRICA PLC RegS	D – Energieversorgung	3,7 %	Großbritannien
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA NC5.5 RegS	E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	3,5 %	Frankreich
ENBRIDGE INC	H – Verkehr und Lagerei	3,4 %	Kanada
BP CAPITAL MARKETS PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,1 %	Großbritannien
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE N RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,7 %	Deutschland
SOLVAY SA RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	Belgien
BAYER AG RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	Deutschland
ENBW ENERGIE BADEN WUERTTEMBERG AG RegS	D – Energieversorgung	2,1 %	Deutschland
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA RegS	E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	2,0 %	Frankreich
EVONIK INDUSTRIES AG RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,9 %	Deutschland

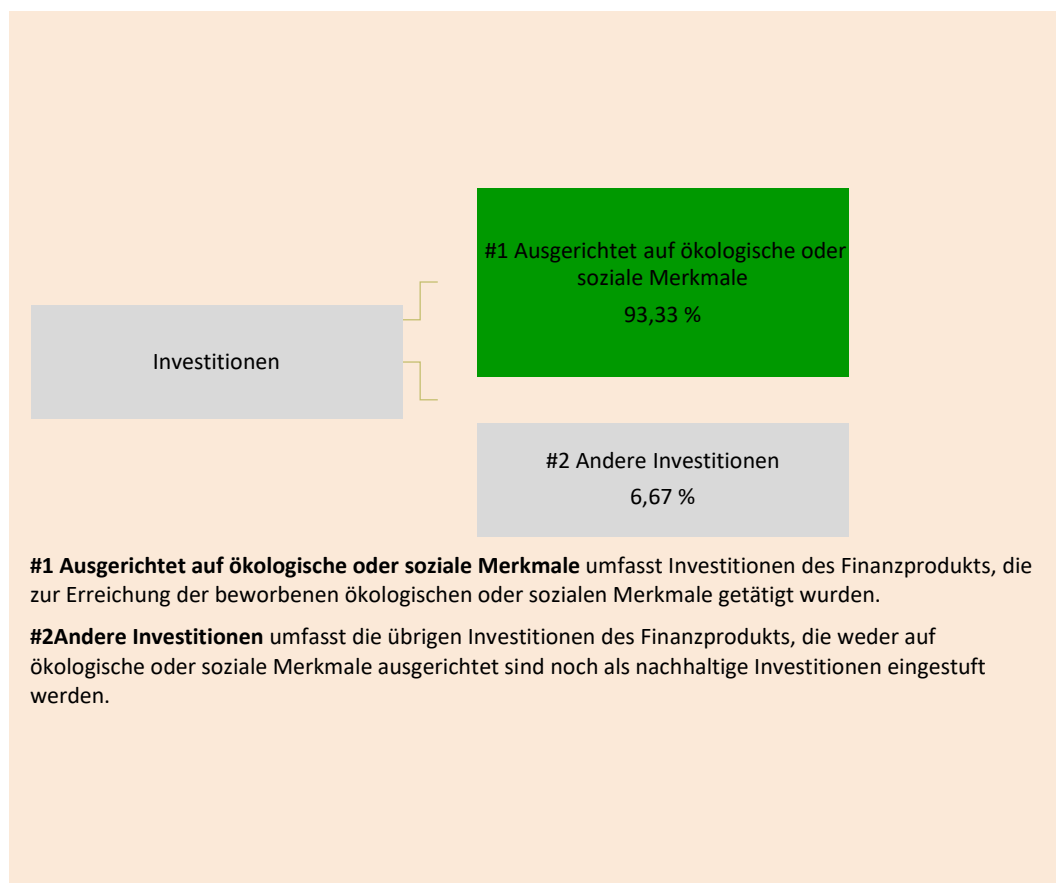


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,01 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	19,24 %
D – Energieversorgung	37,22 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	7,48 %
F – Baugewerbe/Bau	0,00 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,02 %
H – Verkehr und Lagerei	3,79 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,00 %
J – Information und Kommunikation	7,80 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	23,95 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,45 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,00 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,01 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,02 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,00 %
U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,00 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

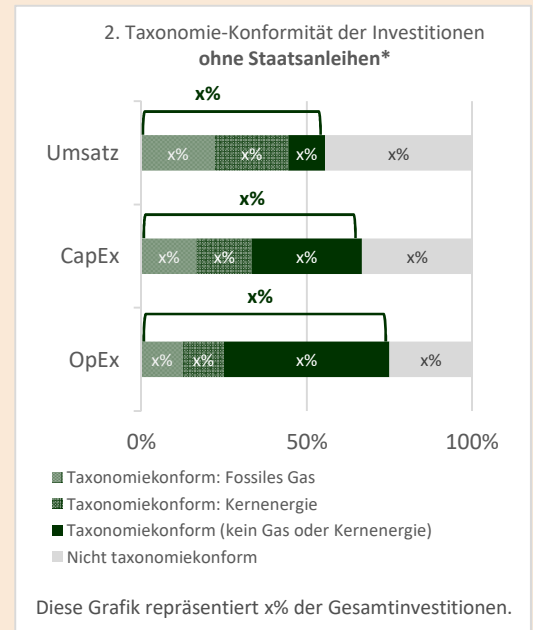
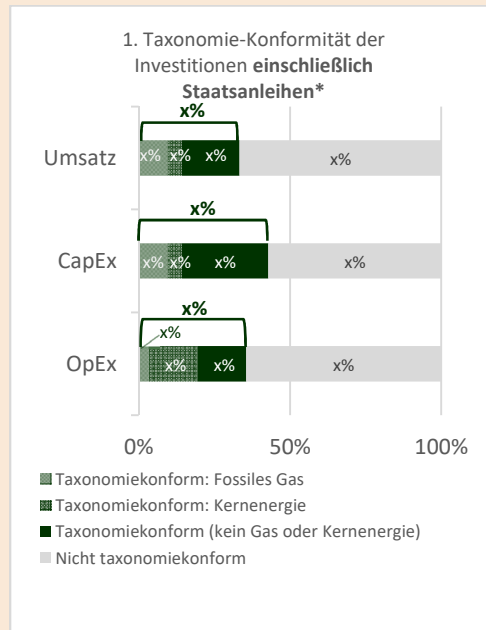
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht**



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493004BPE0UFYX6FZ81

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

<b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>	
<span style="color: green;">●</span> <span style="color: green;">●</span> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<span style="color: green;">●</span> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> <b>Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</b>  <div style="margin-left: 40px;"> <input type="checkbox"/> in                      Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <div style="margin-left: 40px; margin-top: 10px;"> <input type="checkbox"/> in                      Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind                 </div> <input type="checkbox"/> <b>Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</b>	<input type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und</b>  obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel  <input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	62	93 %
Daten von Dritten	5,1	

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 12,92 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügt. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 48 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-**

**Normen“)** verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig waren und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MCAFEE PIK PREF EQUITY Prvt	J – Information und Kommunikation	1,4 %	USA
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerei	1,3 %	USA
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	USA
BOEING CO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,8 %	USA
TRNTS_20-12X D RegS	k. A.	0,8 %	Kaimaninseln
DRSLF 21-93X D RegS	k. A.	0,8 %	Kaimaninseln
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,7 %	USA
ASSUREDPARTNERS INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,7 %	USA
AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCA	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,7 %	Irland
UNITED AIR 2020-1 A PTT	H - Verkehr und Lagerei	0,6 %	USA
IRON MOUNTAIN INC 144A	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,6 %	USA
AIMCO 21-16X D RegS	k. A.	0,6 %	Kaimaninseln
PETROLEOS MEXICANOS MTN	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,6 %	Mexiko
EPR PROPERTIES	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,6 %	USA

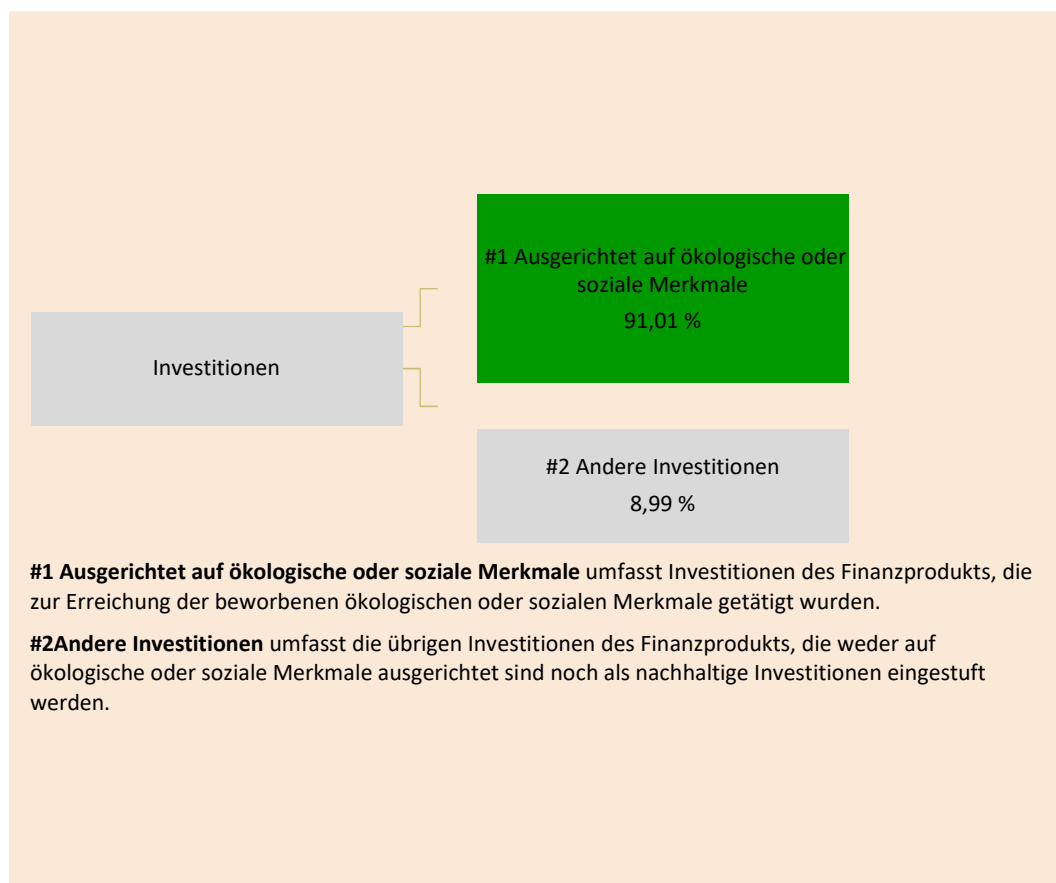


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	4,70 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	14,48 %
D – Energieversorgung	2,51 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,44 %
F – Baugewerbe/Bau	1,38 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,29 %
H - Verkehr und Lagerei	6,41 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,88 %
J – Information und Kommunikation	12,01 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	30,08 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,83 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,74 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	6,51 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,75 %

P – Erziehung und Unterricht	0,00 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,91 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,05 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,00 %
U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,08 %
Keine	7,94 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

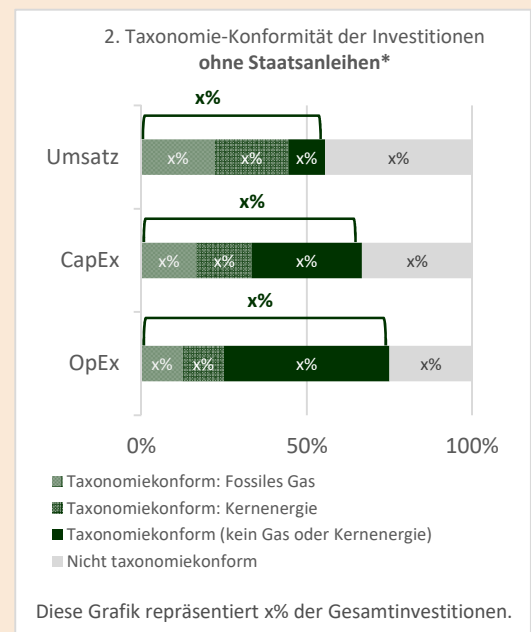
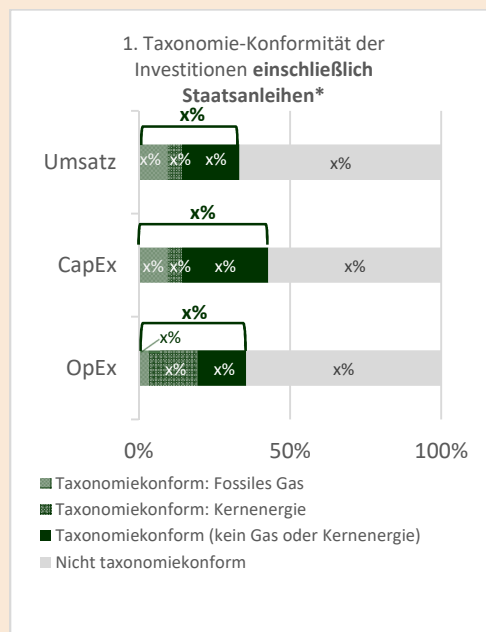
- Ja:
- In fossiles Gas       In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.





### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum verringerte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300TIVE0UW3FSBE51

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analysteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	62	100 %
Daten von Dritten	6,7	

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (**“CVaR”**) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 3,41 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 71 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (**„UNGC-Grundsätze“**), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (**„OECD -Leitsätze“**), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte (**„UNGPs“**) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen (**„ILO-Normen“**) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.





## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,2 %	USA
UNITED AIR 2020-1 A PTT	H - Verkehr und Lagerei	1,7 %	USA
HSBC HOLDINGS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,5 %	Großbritannien
AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,2 %	Irland
BANK OF AMERICA CORP MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	USA
BANK OF MONTREAL	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Kanada
BARCLAYS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Großbritannien
WESTPAC BANKING CORP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Australien
SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO	D – Energieversorgung	1,1 %	USA
NATWEST GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Großbritannien
MARATHON PETROLEUM CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,0 %	USA
LLOYDS BANKING GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Großbritannien
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Südafrika
CAPITAL ONE FINANCIAL CORPORATION	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA
ATHENE GLOBAL FUNDING 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA

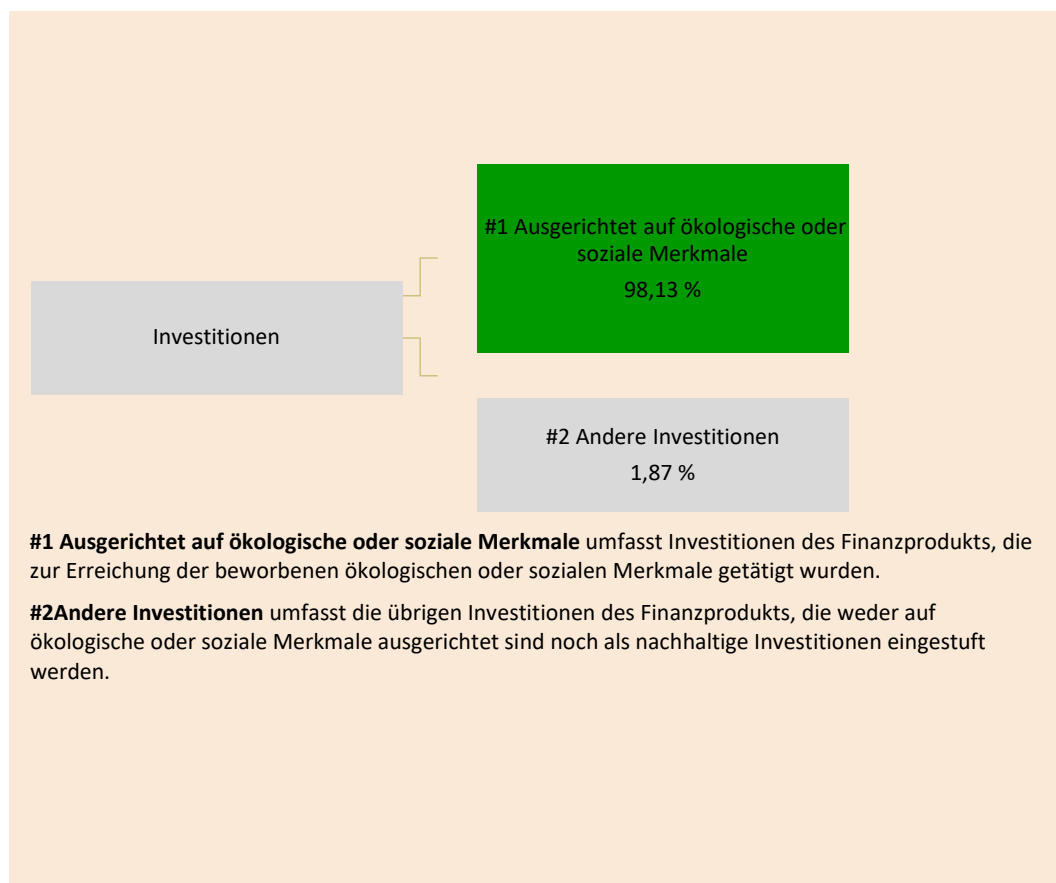


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,08 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	14,03 %
D – Energieversorgung	7,55 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,61 %
F – Baugewerbe/Bau	0,12 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,88 %
H – Verkehr und Lagerei	4,66 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,67 %
J – Information und Kommunikation	11,54 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	48,31 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,95 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,69 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,15 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,29 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,26 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,21 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

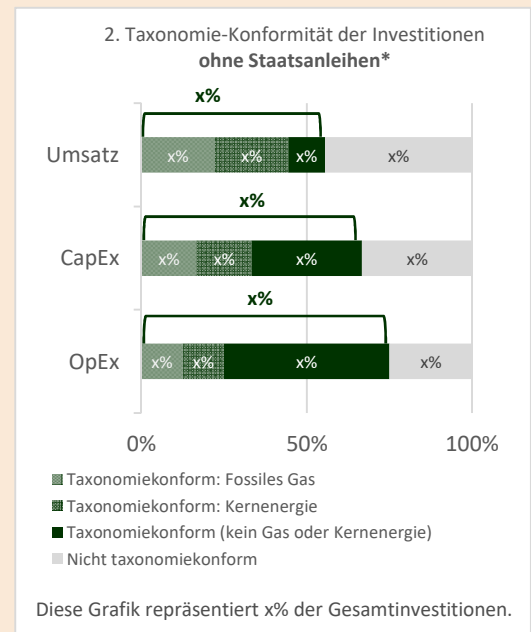
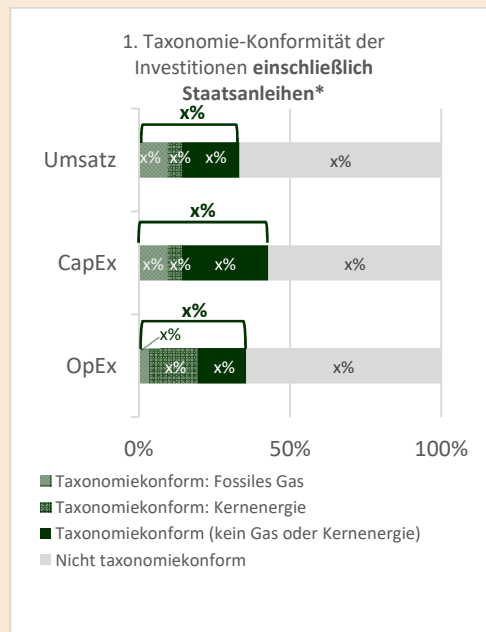
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300577U1V3H24JG33

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Angesichts des Anlageziels, der Anlagedauer und der Fälligkeit (30. Juni 2024) war der Portfolioumschlag begrenzt. Aus diesem Grund wurden die ökologischen und sozialen Merkmale vor allem in der Phase der Portfoliokonstruktion beworben.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB-ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektor Kriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	57	98 %
Daten von Dritten	4,9	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 3,64 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 72 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von

Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig waren und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Da das Portfolio darauf abzielte, eine Rendite über eine bestimmte Laufzeit zu erzielen, die am Fälligkeitsdatum endet, war der Portfolioumschlag begrenzt.

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

### *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

### *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NATWEST GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,9 %	Großbritannien
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,8 %	USA
DIB SUKUK LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,6 %	Vereinigte Arabische Emirate
BARCLAYS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,5 %	Großbritannien
MAGALLANES INC 144A	J – Information und Kommunikation	2,5 %	USA
ATHENE GLOBAL FUNDING 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	USA
NRG ENERGY INC 144A	D – Energieversorgung	2,4 %	USA
SYNCHRONY FINANCIAL	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	USA
MASHREQBANK PSC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	Vereinigte Arabische Emirate
EQT MIDSTREAM PARTNERS LP	H – Verkehr und Lagerei	2,3 %	USA
PRIME SECURITY SERVICES BORROWER L 144A	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,2 %	USA
ONEMAIN FINANCE CORP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	USA
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,1 %	Indonesien
BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO) TB RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,0 %	Indonesien
AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,9 %	Irland

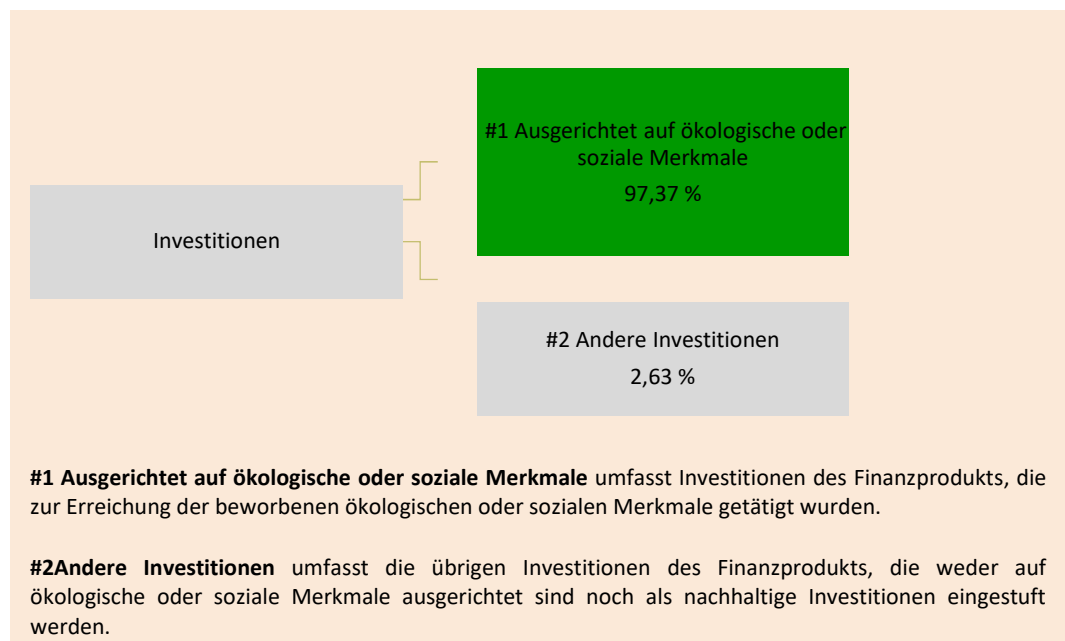


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,98 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,70 %
D – Energieversorgung	3,71 %
F – Baugewerbe/Bau	1,39 %
H - Verkehr und Lagerei	7,11 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,50 %
J – Information und Kommunikation	4,34 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	59,69 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,73 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,63 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	4,88 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,56 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,44 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,83 %
Keine	3,53 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas In

Kernenergie

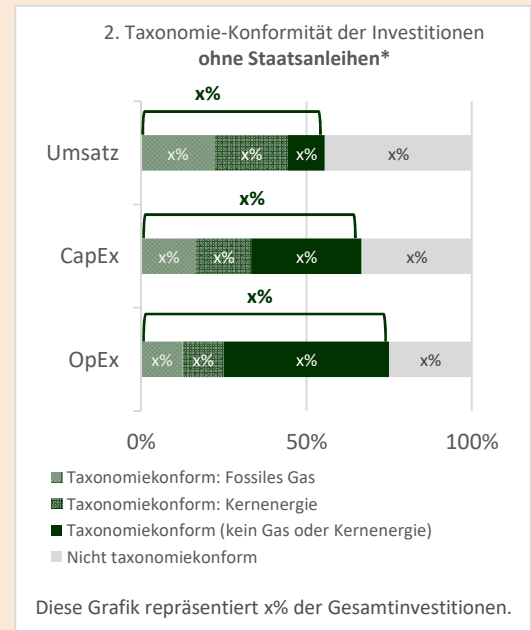
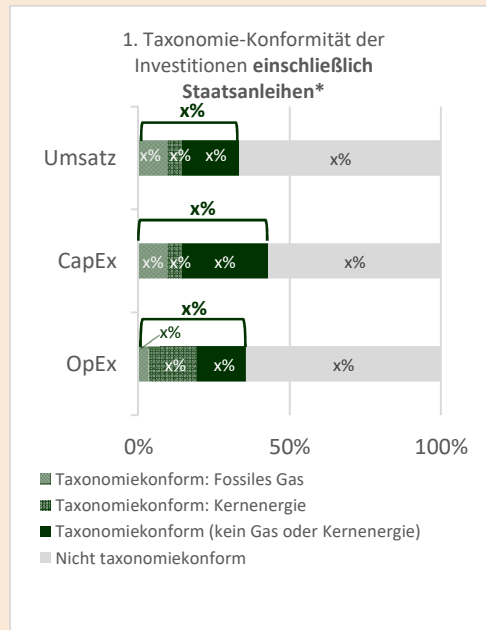
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.





## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten bei Auflage eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der betreffende Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit bei der Portfoliokonstruktion nicht als Anlage berücksichtigt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager erachtete diese Zusammenarbeit mit Emittenten als wichtigen Bestandteil seines Anlageprozesses, der es ihm ermöglichte sicherzustellen, dass die erstmalige Beurteilung des Emittenten (bei Auflage) weiterhin zutreffend war und in die laufende Bewertung durch das NB-ESG-Quotient-Rating einfluss. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300ZPJNN43P39QR29

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB-ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektoorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	66	94 %
Daten von Dritten	6,5	

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 4,96 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 17 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der

Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“) für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.





## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PORTUGAL (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,8 %	Portugal
ITALY (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,8 %	Italien
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,6 %	Slowakische Republik
BANK OF MONTREAL RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,0 %	Kanada
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,9 %	Italien
GTR 20-1 A RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,9 %	Irland
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,8 %	Polen
FRANCE (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,7 %	Frankreich
FRANCE (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,6 %	Frankreich
PORTUGAL GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,5 %	Portugal
KFW	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,5 %	Deutschland
CROATIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,5 %	Kroatien
NETHERLANDS (KINGDOM OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Niederlande
ESTONIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Estland
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,2 %	Italien

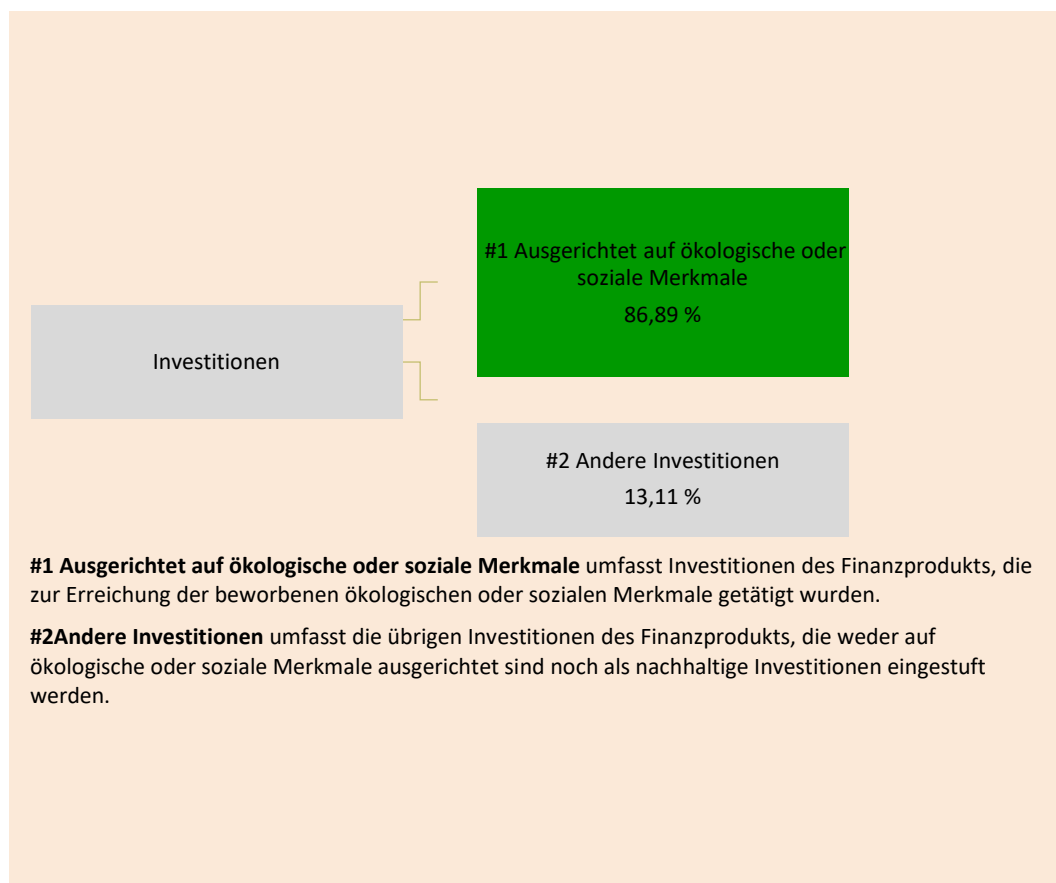


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,46 %
D – Energieversorgung	4,23 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,88 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,31 %
H – Verkehr und Lagerei	2,18 %
J – Information und Kommunikation	2,68 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	35,72 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,30 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,18 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	33,28 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,40 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	2,65 %
Keine	8,73 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

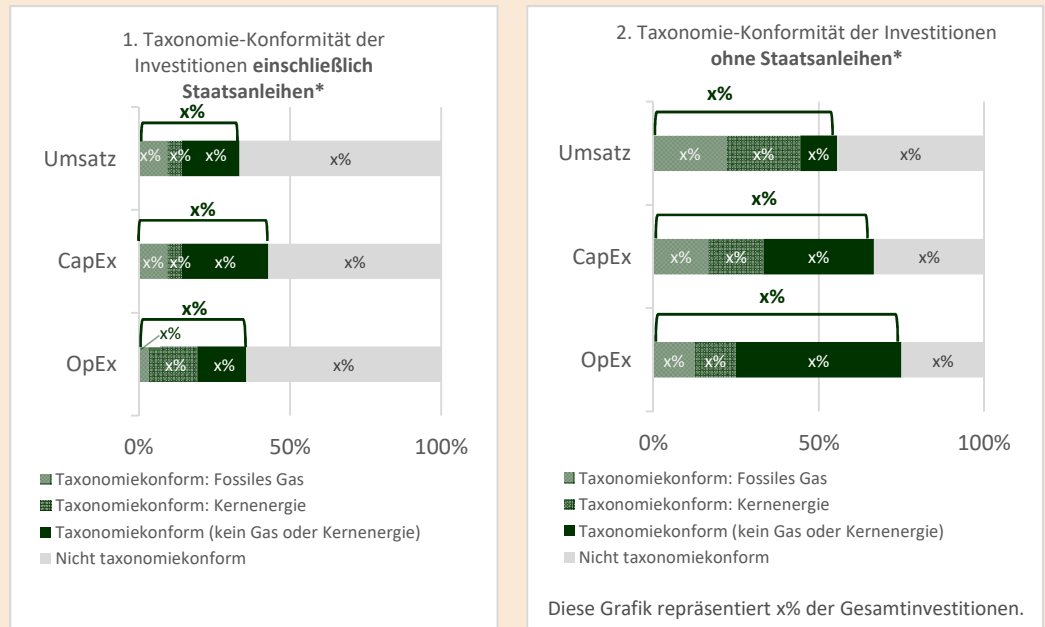
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300TQ5M6FBE2H8T74

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	66	90 %
Daten von Dritten	6,0	

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 5,36 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 12 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der

Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionsintensität und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (die „**staatlichen PAIs**“) für staatliche Emittenten sowie THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Intensität, Engagement in fossilen Brennstoffen, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PORTUGAL (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	3,1 %	Portugal
ITALY (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,0 %	Italien
NETHERLANDS (KINGDOM OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,0 %	Niederlande
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,8 %	Italien
GTR 20-1 A RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,7 %	Irland
ITALY GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,5 %	Italien
BANCO SANTANDER SA RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,5 %	Spanien
FRANCE (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,5 %	Frankreich
ESTONIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	Estland
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,4 %	Italien
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,3 %	Italien
EUROPEAN UNION RegS	U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,1 %	Supranational
ING GROEP NV RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Niederlande
SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO	D – Energieversorgung	1,1 %	USA
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,1 %	Deutschland

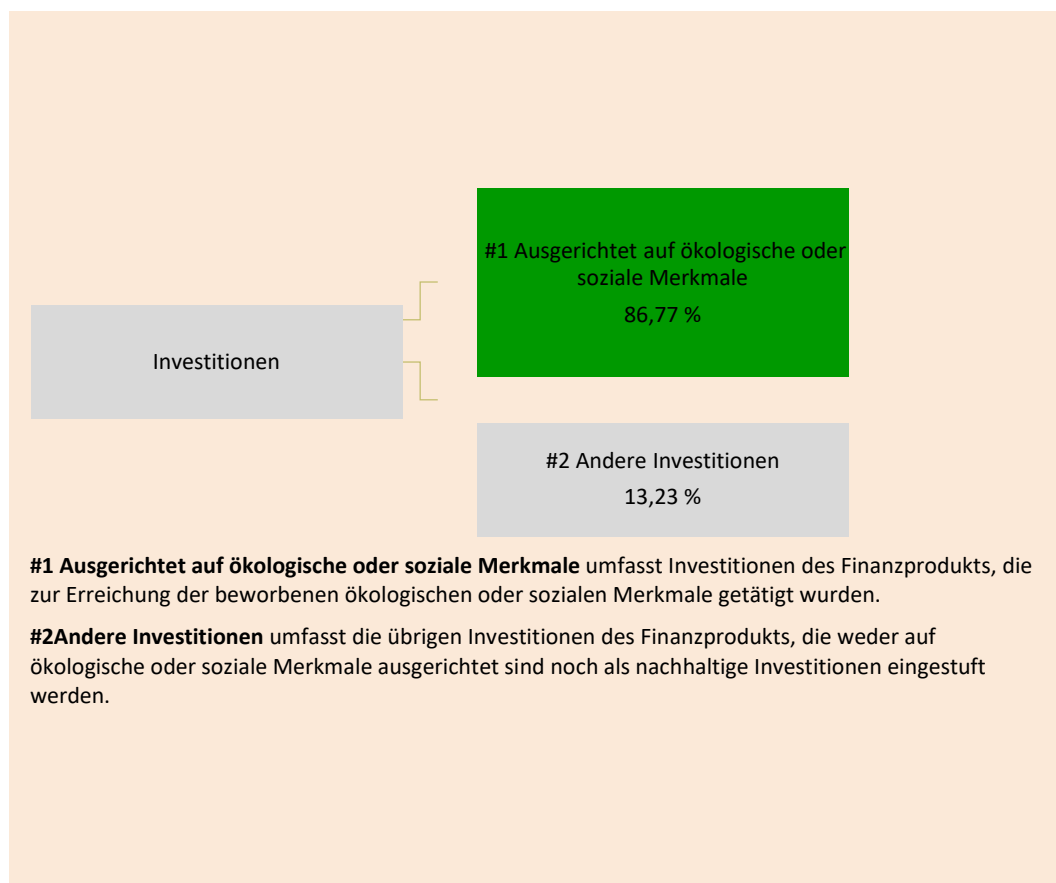


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,70 %
D – Energieversorgung	4,18 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,83 %
H – Verkehr und Lagerei	1,75 %
J – Information und Kommunikation	3,03 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	29,61 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,80 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	41,67 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,07 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	4,08 %
Keine	6,28 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

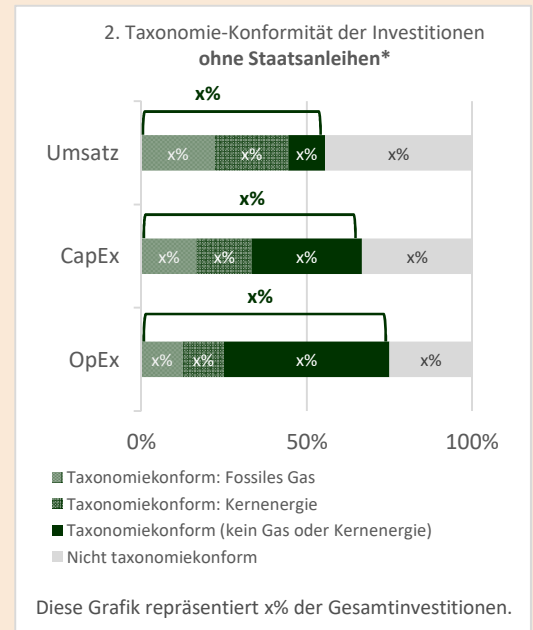
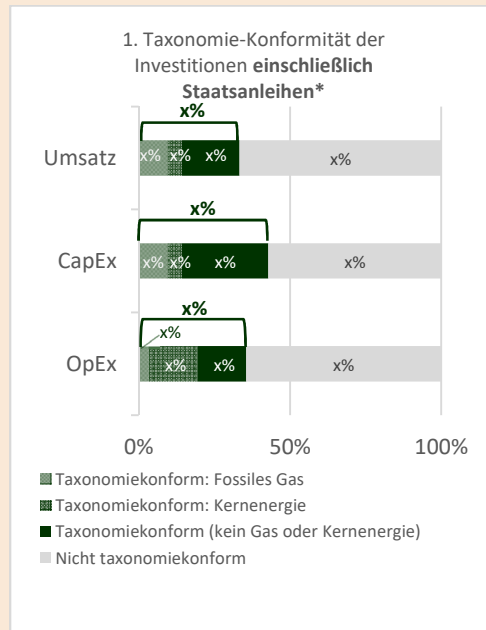
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.





## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493005BLB45D11FOM10

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	62	
Daten von Dritten	6,5	87 %

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 5,34 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 52 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global

Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— — **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— — **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.





## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MIRAV_19-1 A RegS	k. A.	2,2 %	Spanien
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,0 %	USA
MYLAN NV RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,8 %	USA
INTESA SANPAOLO SPA MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,7 %	Italien
AMCO ASSET MANAGEMENT COMPANY SPA MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,4 %	Italien
HEIMSTADEN BOSTAD AB MTN RegS	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,3 %	Schweden
MORGAN STANLEY MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	USA
CK HUTCHISON FINANCE (16) LIMITED RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Großbritannien
LANDSBANKINN HF RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Island
DANSKE BANK A/S MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Dänemark
ATHENE GLOBAL FUNDING RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	USA
BNP PARIBAS SA RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Frankreich
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Frankreich
HOLCIM FINANCE LUX SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,0 %	Schweiz
BARCLAYS BANK PLC MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Großbritannien

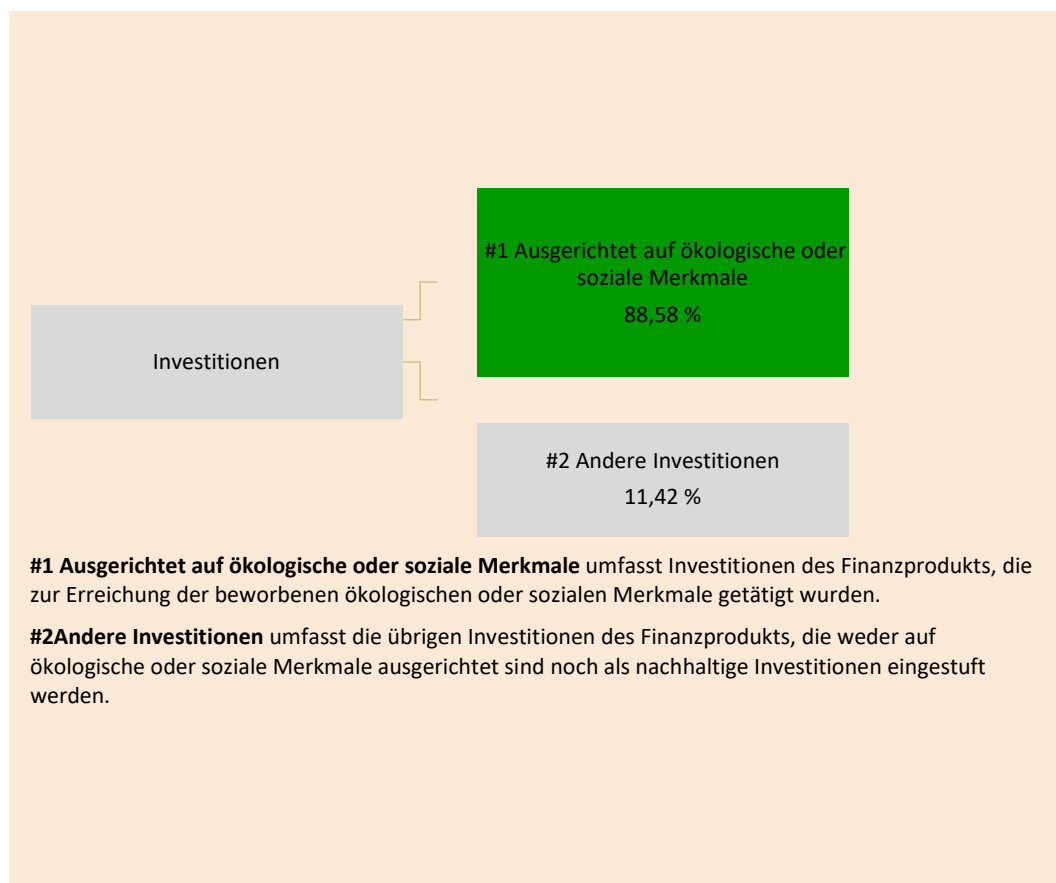


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	11,49 %
D – Energieversorgung	2,46 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,29 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,11 %
H – Verkehr und Lagerei	1,82 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,16 %
J – Information und Kommunikation	2,23 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	57,14 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	5,12 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,48 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	6,04 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,55 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,80 %
Keine	8,31 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

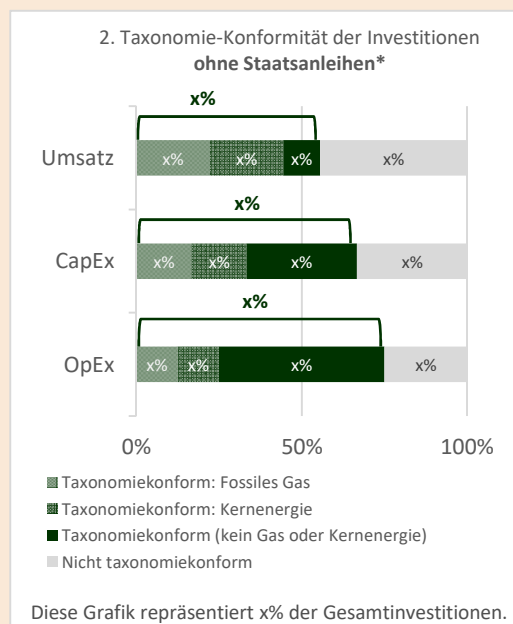
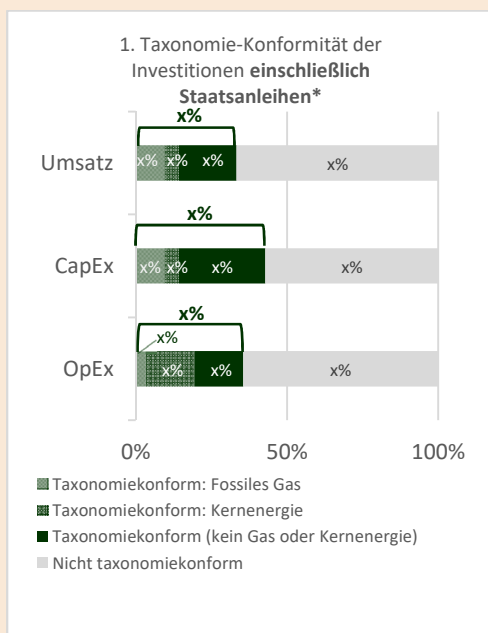
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Für die Emittenten des Portfolios wurden NB-ESG-Quotient-Ratings erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300P7BLMM0H469F71

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Für das in festverzinslichen Wertpapieren mit Investment-Grade-Rating investierte Segment des Portfolios wurden die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Für das in festverzinslichen Wertpapieren ohne Investment-Grade-Rating investierte Segment des Portfolios wurden die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks, THG-Emissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Qualität der Pflege und Patientenzufriedenheit.

Für das in Aktien investierte Segment des Portfolios wurden die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, THG-Emissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten oder einem äquivalenten Rating gemessen und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses für das Portfolio investierten die Sub-Investment-Manager in Strategien, die im Abschnitt „Anlageansatz“ des Nachtrags beschrieben sind (die „**Teilstrategien**“). Die Teilstrategien wurden von einem separaten Sub-Investment-Manager verwaltet (jeder Sub-Investment-Manager, der in dieser Eigenschaft handelt, ist ein „**Sub-Investment-Manager der Teilstrategie**“). Die zur Messung der durch die jeweiligen Teilstrategien des Portfolios beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale verwendeten Nachhaltigkeitsindikatoren werden nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Zur Messung der durch eine bestimmte Teilstrategie des Portfolios beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurde das Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) oder ein äquivalentes ESG-Rating verwendet. Der hauseigene NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Sektorkriterien wurden unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des betreffenden Sub-Investment-Managers der Teilstrategie genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Dementsprechend traten die Sub-Investment-Manager der Teilstrategien unter Umständen in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten oder ein äquivalentes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	<i>Aktienanteil des Portfolios:</i> ES: B G: 1,99 <i>Anleiheanteil des Portfolios:</i> 62,90	96 %
Daten von Dritten	5,93	

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht.

Für den NB-ESG-Quotienten von Emittenten festverzinslicher Anlagen wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt.

Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste

Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 4,29 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des betreffenden Sub-Investment-Managers der Teilstrategie beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der betreffende Sub-Investment-Manager der Teilstrategie über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 15 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapieren von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und

diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

--- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

--- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch die Sub-Investment-Manager der Teilstrategien) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 haben bestimmte Sub-Investment-Manager für Teilstrategien die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des betreffenden Sub-Investment-Managers der Teilstrategie) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der betreffende Sub-Investment-Manager der Teilstrategie nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie das Research der betreffenden Sub-Investment-Manager der Teilstrategien, um die vorstehend aufgeführten PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager oder die betreffenden Sub-Investment-Manager der Teilstrategien erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder die Festlegung von Mitwirkungszielen können von den Sub-Investment-Managern der Teilstrategien bestimmt (oder vom Sub-Investment-Manager einem für eine Teilstrategie zuständigen Sub-Investment-Manager mitgeteilt) werden, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzgrenzen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („**NACE**“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NB CHINA BOND FD USD ZA HEDGED	k. A.	3,4 %	USA
NEUBERGER BERMAN COMMODITIES USD Z	k. A.	1,6 %	Irland
NATWEST GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	Großbritannien
ING GROEP NV	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	Niederlande
CREDIT SUISSE GROUP AG RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Schweiz
NGG FINANCE PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Großbritannien
TARGA RESOURCES CORP	H – Transport und Lagerung	1,0 %	USA
PETROLEOS MEXICANOS RegS	B – Bergbau und Steine & Erden	0,9 %	Mexiko
ASSEMBLIN FINANCING AB (PUBL) RegS	F – Baugewerbe/Bau	0,9 %	Schweden
ADIANT GLOBAL HOLDINGS LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Jersey, Kanalinsel

ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS	D – Energieversorgung	0,9 %	Frankreich
ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS	D – Energieversorgung	0,9 %	Frankreich
EG GLOBAL FINANCE PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Großbritannien
AVANTOR FUNDING INC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	USA
TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Deutschland

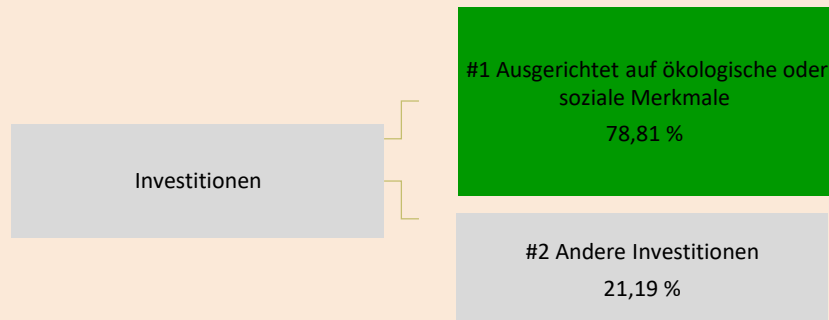


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der betreffende Sub-Investment-Manager der Teilstrategie direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	0,00 %
B – Bergbau und Steine & Erden	1,63 %
C – Fertigung	17,06 %
D – Energieversorgung	11,29 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	1,09 %
F – Baugewerbe/Bau	1,64 %
G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,30 %
H – Transport und Lagerung	6,96 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,30 %
J – Information und Kommunikation	6,57 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	33,21 %
L – Immobilienaktivitäten	7,87 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,16 %
N – Verwaltungs- und Unterstützungsdienstleistungen	1,44 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	4,10 %
P – Erziehung und Unterricht	0,00 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,18 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,01 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,00 %
Keine	4,18 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager und die betreffenden Sub-Investment-Manager der Teilstrategien werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

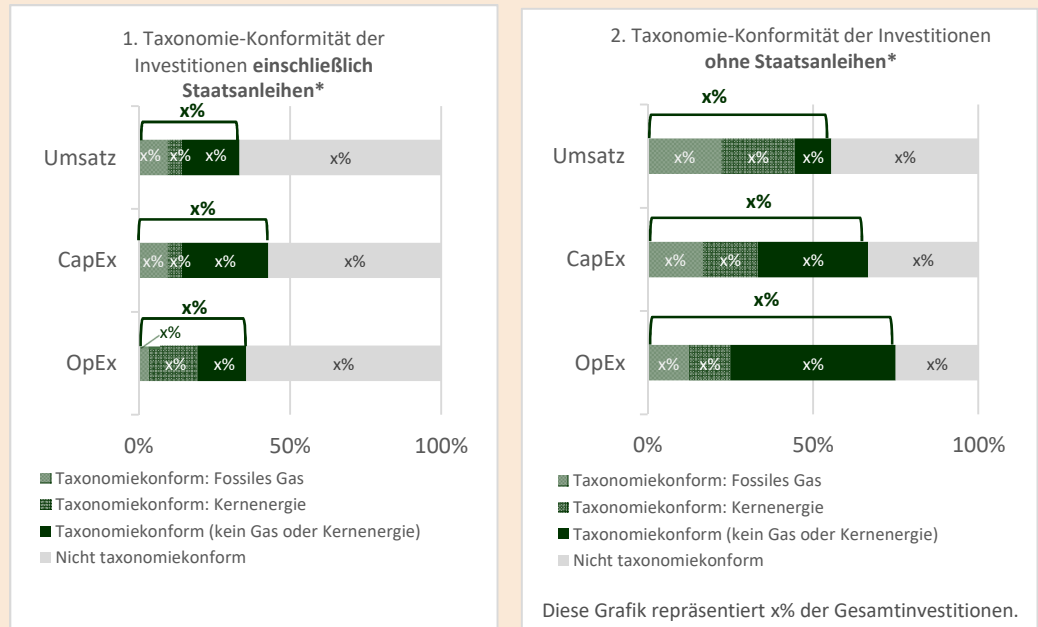
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten. Die Teilstrategien, die ESG nicht in ihre Anlageprozesse integrieren, fielen in diese Kategorie von Anlagen.

Abgesehen von solchen Teilstrategien (die für Anlagezwecke verwendet wurden), wurden die „Anderen Investitionen“ im Portfolio aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Sub-Investment-Manager oder der betreffende Sub-Investment-Manager der Teilstrategie als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhindert und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der NB-ESG-Quotient oder äquivalente Ratings wurden von bestimmten Sub-Investment-Managern der Teilstrategien für Emittenten im Portfolio erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen.

Für das festverzinsliche Segment des Portfolios war das Rating eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden. Sofern dem der Fall war, wurde dies als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio von den betreffenden Sub-Investment-Managern der Teilstrategien überwacht.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings/Gesamtbeurteilung des Emittenten bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie. Dementsprechend können die betreffenden Sub-Investment-Manager der Teilstrategien in einen Dialog mit Emittenten eintreten, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten oder ein äquivalentes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

### **II. Mitwirkung:**

Bestimmte Sub-Investment-Manager der Teilstrategien arbeiteten mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden zentral in einem System von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300VLTCS1K4EA7H66

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 64,80 %\* an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Im Zuge der Leitlinien der Europäischen Kommission zur Einstufung von Portfolios gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 („SFDR“) wurde das Portfolio am 19. August 2022 von einem Artikel-9-Portfolio in ein Artikel-8-Portfolio 8 umgestuft. Diese regelmäßige Offenlegung wurde daher auf Basis der Anforderungen erstellt, die für ein Artikel-8-Portfolio gemäß SFDR gelten.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager künftig die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.<sup>1</sup> Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem Composite-ESG-Rating gemessen und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### I. Das Composite-ESG-Rating:

Die vorstehend aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale wurden anhand einer Mischung aus ökologischen und sozialen Merkmalen abgeleitet und beurteilt, die aus dem hausinternen Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) und einem themenbasierten ESG-Ratingsystem („**NB-ESG-Themen**“), (zusammen das „**Composite-ESG-Rating**“) stammen.

Der NB- ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet. Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Das Ratingsystem in Bezug auf NB-ESG-Themen basiert auf dem Konzept sektorspezifischer ESG-Themen (bereitgestellt von Drittanbietern), die individuell gewichtet wurden und ein

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

unternehmensspezifisches Gesamtrating in Bezug auf NB-ESG-Themen ergaben. Die sektorspezifischen NB-ESG-Themen erstreckten sich auf einzelne wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale oder aggregierten wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale, die ihrerseits ein ESG-Thema bilden. Die betreffenden ökologischen und sozialen Merkmale sind vorstehend aufgeführt und Teil der übergeordneten ESG-Themen.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden Composite-ESG-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten Composite-ESG-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
Composite-ESG-Rating	0,60	100 %
Daten von Dritten	7,3	

Für das Composite-ESG-Rating wird ein Wert zwischen -1 und +1 verwendet, wobei -1 das niedrigste und +1 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Composite-ESG-Mindestrating. Das durchschnittliche Composite-ESG-Rating ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## II. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem Composite-ESG-Rating und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens hat der Sub-Investment-Manager Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen und Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 investierte der Sub-Investment-Manager nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — —  
*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die beabsichtigten nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — —  
*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 investierte der Sub-Investment-Manager nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.

2. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, nämlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,9 %	USA
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	1,5 %	USA
GILEAD SCIENCES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,4 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	1,3 %	USA
GOLDMAN SACHS GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	USA
VALERO ENERGY CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung	1,3 %	USA
MARATHON PETROLEUM CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung	1,2 %	USA
ABBVIE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,2 %	USA
TOTALENERGIES	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung	1,2 %	Frankreich
MERCK & CO INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung	1,2 %	USA
AT&T INC	J – Information und Kommunikation	1,2 %	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	USA
ANGLO AMERICAN PLC	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen	1,2 %	Südafrika
PHILLIPS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung	1,1 %	USA
CIGNA CORP	Q – Gesundheitswesen, Heime und	1,1 %	USA

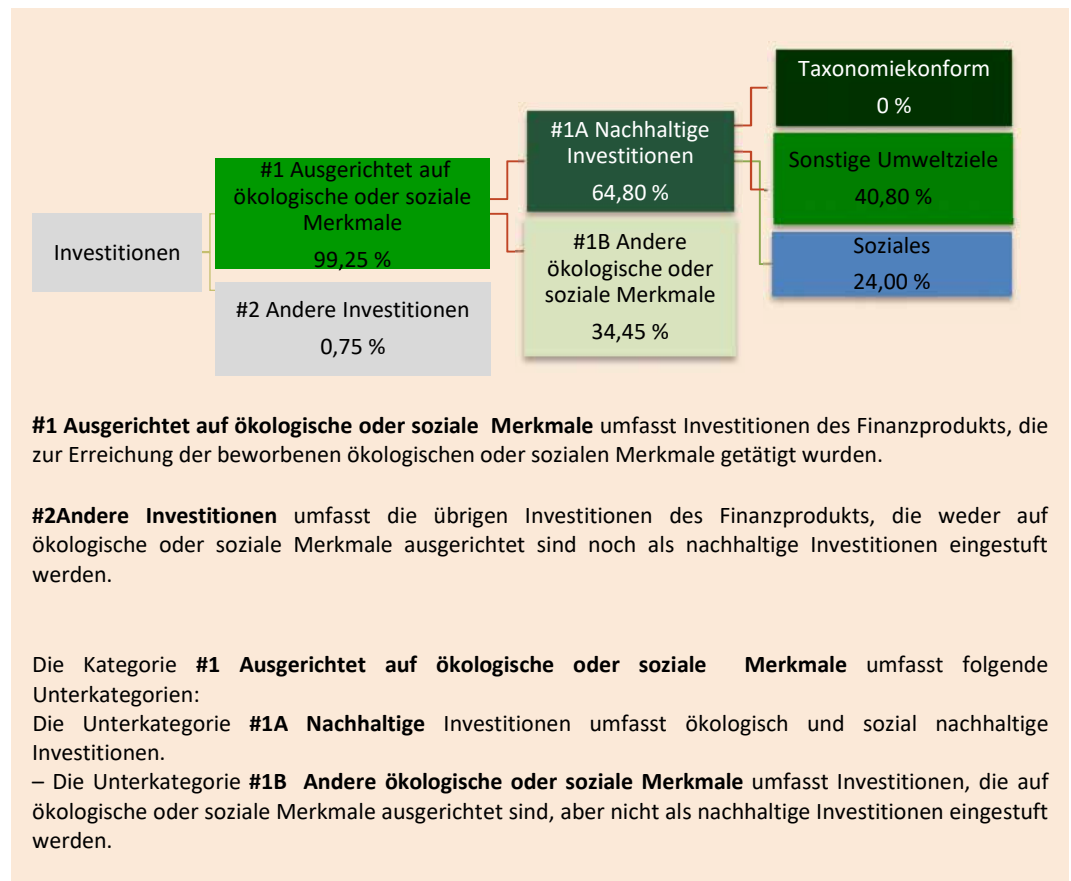


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein ESG-Composite-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte, und seine Berechnungen können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Dritten beruhen. Die Berechnung beruhte auf einer Marktbewertung des Portfolios. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	3,83 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	42,34 %
D – Energieversorgung	1,23 %
F – Baugewerbe/Bau	1,34 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	6,24 %
H – Verkehr und Lagerei	4,58 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,41 %
J – Information und Kommunikation	10,55 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	21,56 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,52 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,95 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,51 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,44 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,11 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,32 %
Keine	0,07 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, ob das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

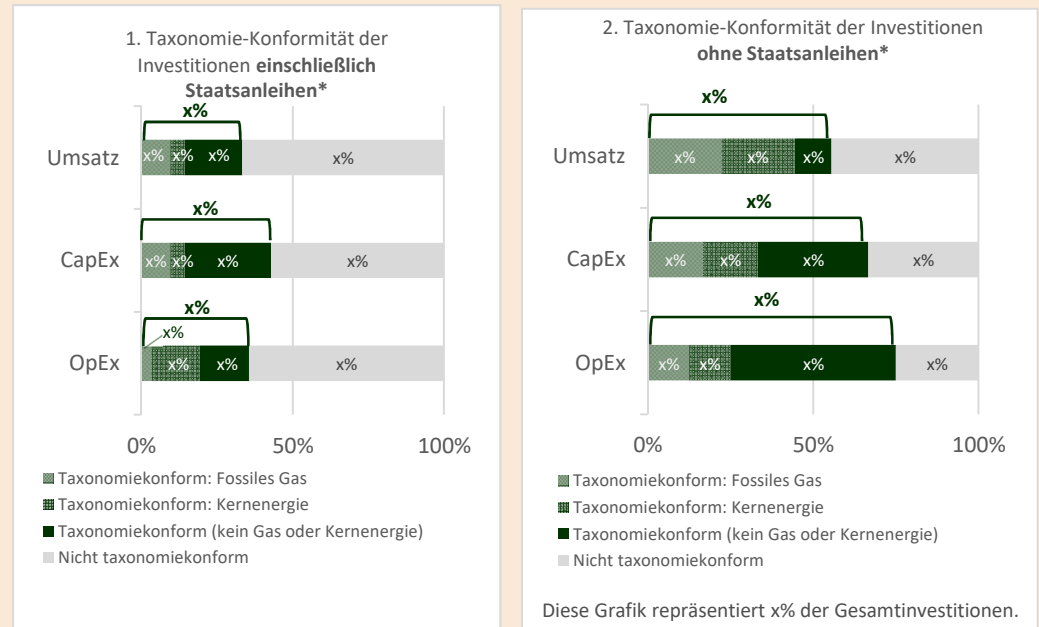
Nein

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**


Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

40,80 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

24,00 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.





## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Das Composite-ESG-Rating wurde für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Der NB-ESG-Quotient (wie vorstehend erläutert) wurde verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB (wie vorstehend erläutert), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wurde.

Die NB-ESG-Themen basieren auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Themen, die individuell gewichtet wurden, und ergaben ein unternehmensspezifisches Gesamtrating in Bezug auf ESG-Themen, indem sie anhand thematischer Kennzahlen bewertet wurden, die aus Daten Dritter abgeleitet wurden.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden Composite-ESG-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten Composite-ESG-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager nutzte die von NB intern geführten Dialoge mit den Managementteams der Unternehmen. Dies wurde durch ein robustes ESG-Dialogprogramm erreicht, das auf Ebene der NB-Einheiten und nicht auf Portfolioebene stattfand. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen intern geführten Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Die Benchmark des Portfolios wurde nicht als Referenzwert bestimmt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 54930034RCIO16VO2Z23

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.



Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der ESG-Rahmen fand auf das Long-Segment des Portfolios Anwendung, das einen mehrjährigen Anlagehorizont verfolgt. Die Short-Positionen des Sub-Investment-Managers werden über Derivate zum Ausdruck gebracht und waren daher nicht zur Berücksichtigung von ESG-Faktoren verpflichtet. Genauere Angaben zur erwarteten Long/Short-Allokation des Portfolios finden sich im Abschnitt „Anlageansatz“ des Nachtrags.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Long-Segment des Portfolios aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Long-Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Long-Segment des Portfolios entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,2	98 %
Daten von Dritten	6,5	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4

dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0 bis 10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 16,60 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 59 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Lediglich Long-Positionen wurden durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschlusspolitik abgedeckt.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-

Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Dieses Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen zu berücksichtigen.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	3,5 %	USA
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
NEXTERA ENERGY INC	D – Energieversorgung	2,3 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,2 %	USA
UNION PACIFIC CORP	H - Verkehr und Lagerei	2,1 %	USA
S&P GLOBAL INC	J – Information und Kommunikation	2,0 %	USA
TJX INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,0 %	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,0 %	USA
ADOBE INC	J – Information und Kommunikation	2,0 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	1,9 %	USA
SALESFORCE INC	J – Information und Kommunikation	1,9 %	USA
MCDONALDS CORP	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,7 %	USA
CME GROUP INC CLASS A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,6 %	USA
META PLATFORMS INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	1,6 %	USA
KEURIG DR PEPPER INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,3 %	USA

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022



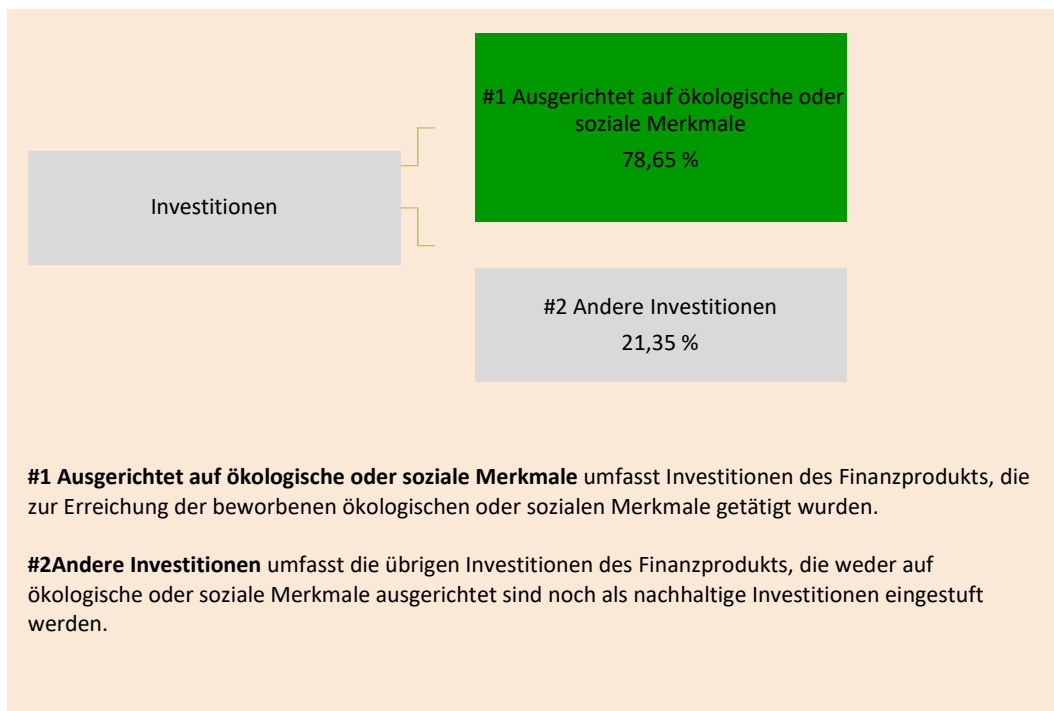
### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

#### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



### ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	26,57 %
D – Energieversorgung	5,61 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	1,43 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	11,68 %
H – Verkehr und Lagerei	3,93 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	3,10 %
J – Information und Kommunikation	27,14 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	13,64 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,03 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,05 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,05 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,00 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,19 %
Keine	1,58 %





## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Im der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** einhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

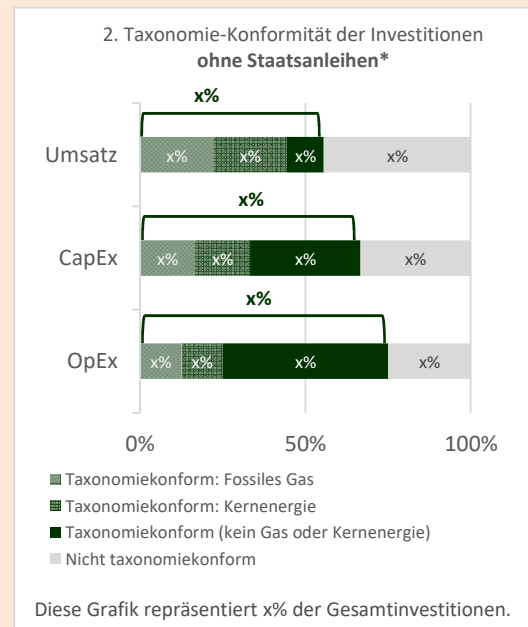
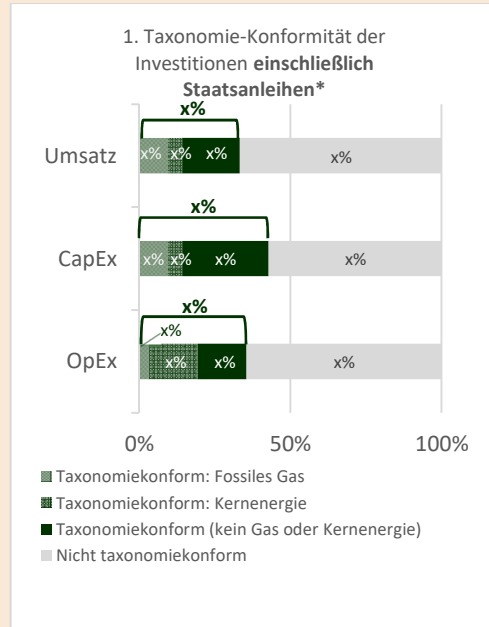
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



**Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



**Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt

sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient- oder externe Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (das NB-ESG-Quotient- und externe Rating) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Unternehmen mit einem günstigen oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Long-Segment des Portfolios aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn das betreffende Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Long-Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Long-Segment des Portfolios entfernt.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses für das Long-Segment. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die im Long-Segment des Portfolios beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Long-Segment des Portfolios die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie vorstehend erwähnt, werden lediglich Long-Positionen durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschlusspolitik abgedeckt.



## **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Small Cap Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300CG2QDECVFZQ378

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB-ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

	Rating	Kombinierte Abdeckung
<b>31. Dezember 2022</b>		
NB-ESG-Quotient	ES: C G: 2,3	100 %
Daten von Dritten	5,4	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ab dem 19. August 2022 erwarb das Portfolio keine Wertpapiere mehr von Unternehmen, die einen bedeutenden Anteil ihrer Umsätze durch Schusswaffen, Tabak, Glücksspiele oder Erwachsenenunterhaltung erzielten. Ab dem 28. November 2022 erwarb das Portfolio keine Wertpapiere mehr von Unternehmen, die Schusswaffen herstellten oder mindestens 5% ihrer Umsätze durch Tabak, Glücksspiele oder Erwachsenenunterhaltung erzielten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio hielt keine taxonomiekonformen Investitionen.



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen



Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO2-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
POOL CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,3 %	USA
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,2 %	USA
VALMONT INDS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,1 %	USA
BIO TECHNE CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,0 %	USA
CHEMED CORP	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,0 %	USA
NEXSTAR MEDIA GROUP INC	J – Information und Kommunikation	1,9 %	USA
FAIR ISAAC CORP	J – Information und Kommunikation	1,9 %	USA
MANHATTAN ASSOCIATES INC	J – Information und Kommunikation	1,9 %	USA
EXPONENT INC	M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,8 %	USA
HAEMONETICS CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,8 %	USA
RBC BEARINGS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,8 %	USA
SPS COMMERCE INC	J – Information und Kommunikation	1,7 %	USA

TORO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,7 %	USA
POWER INTEGRATIONS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,7 %	USA
FOX FACTORY HOLDING CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,6 %	USA

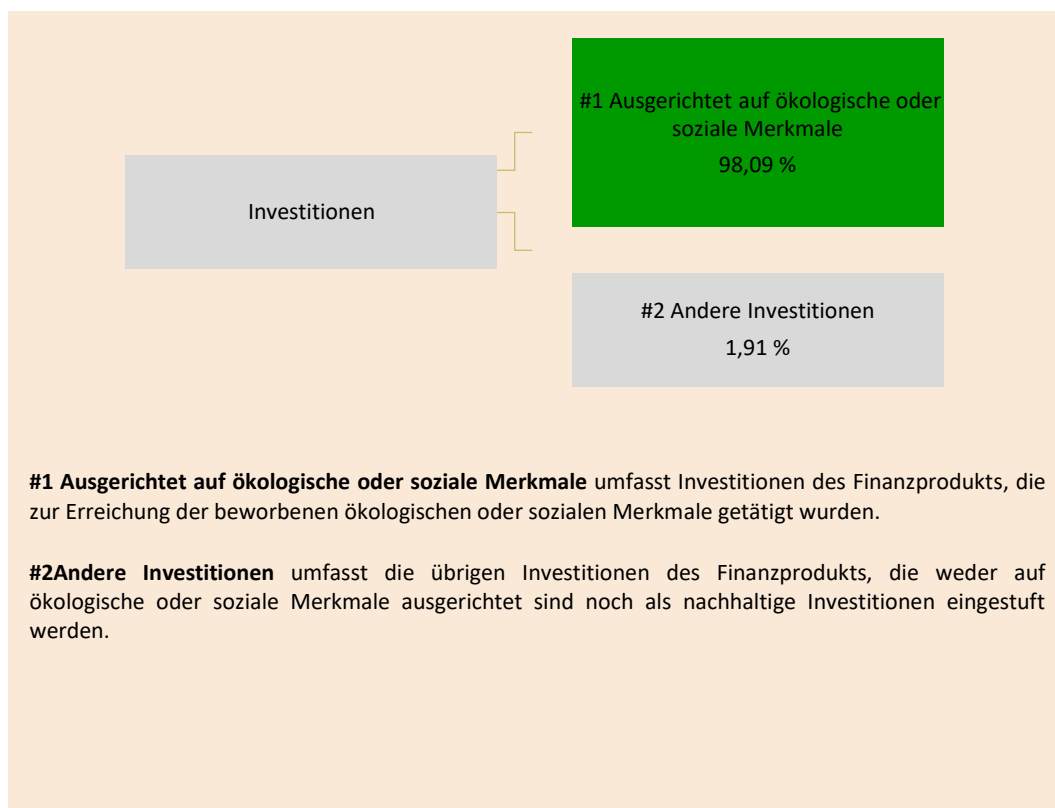


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,24 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	40,36 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	8,58 %
H – Verkehr und Lagerei	2,62 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,06 %
J – Information und Kommunikation	17,21 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	15,50 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,47 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	6,85 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,64 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,48 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

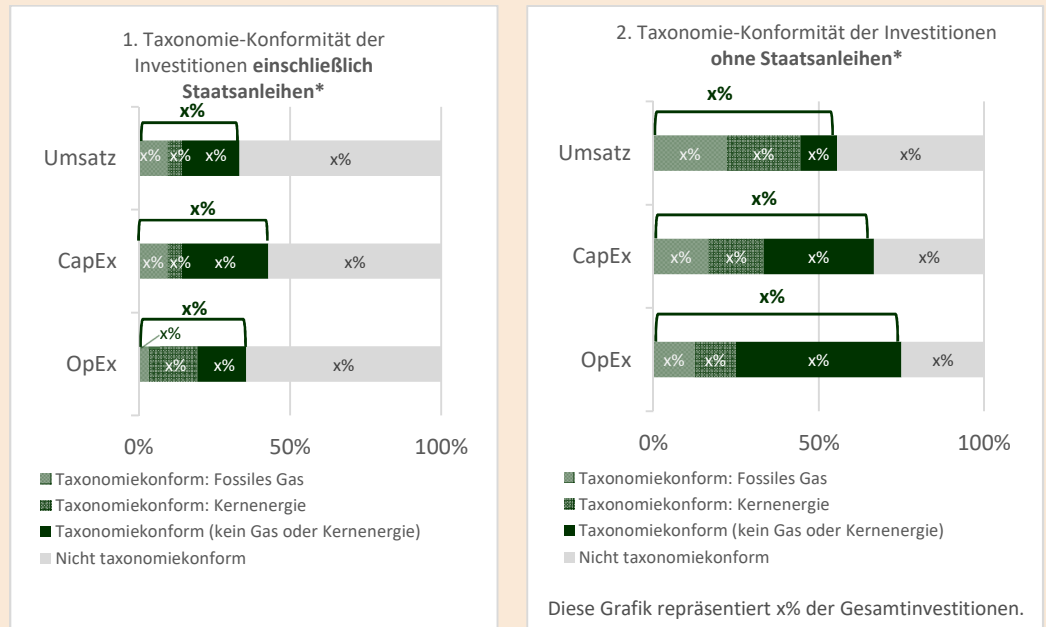
- Ja:  In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhindert und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.



**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300K77TBAIVA0NY51

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

	Rating	Kombinierte Abdeckung
<b>31. Dezember 2022</b>		
NB-ESG-Quotient	ES: C G: 2,3	99 %
Daten von Dritten	6,2	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 12,59 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 99 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-

Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	5,3 %	USA
HCA HEALTHCARE INC	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,9 %	USA
ALPHABET INC CLASS C	J – Information und Kommunikation	3,8 %	USA
GRAPHIC PACKAGING HOLDING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,8 %	USA
ARAMARK	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	3,7 %	USA
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	3,6 %	USA
MOTOROLA SOLUTIONS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	USA
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	USA
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	USA
CSX CORP	H - Verkehr und Lagerei	3,3 %	USA
JPMORGAN CHASE	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,1 %	USA
BROOKFIELD CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %	Kanada
T MOBILE US INC	J – Information und Kommunikation	2,9 %	USA
US FOODS HOLDING CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,6 %	USA
CHUBB LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,6 %	USA



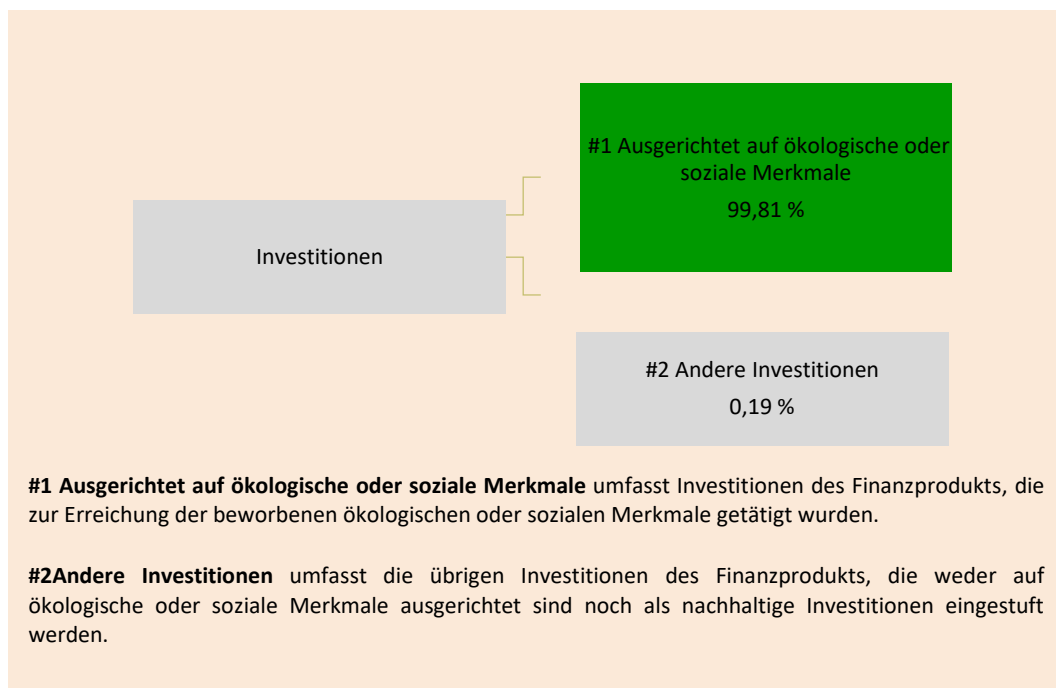
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios

folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

<b>Zum 31. Dezember 2022</b>	
<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	38,89 %
D – Energieversorgung	1,23 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	12,16 %
H - Verkehr und Lagerei	3,34 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	6,09 %
J – Information und Kommunikation	11,36 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	18,46 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,98 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,87 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,94 %
Keine	0,68 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

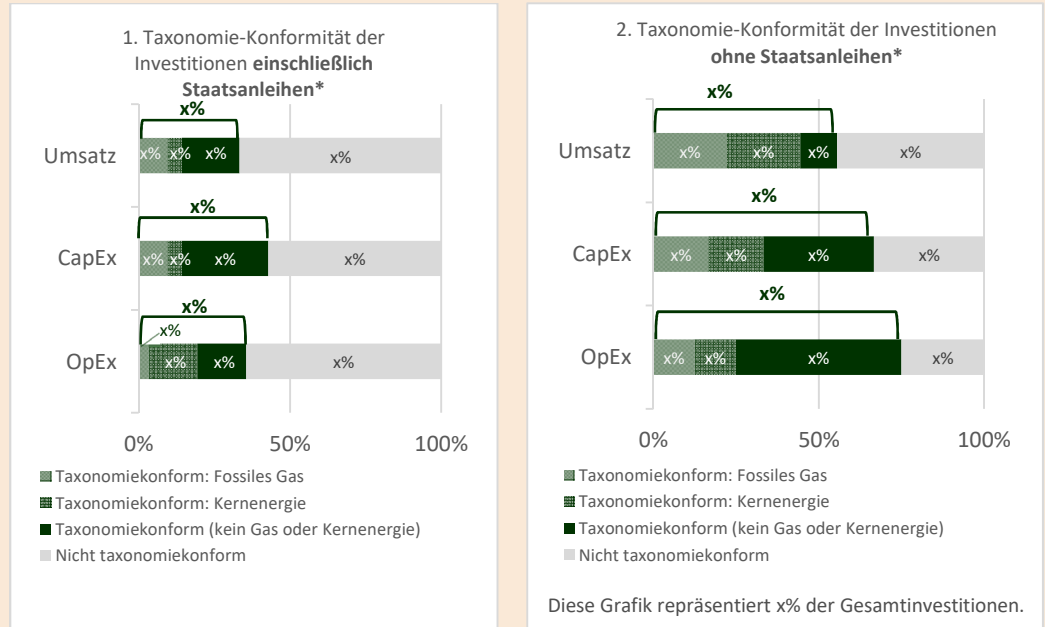
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300GF328Y6TQJI517

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus überwacht der Sub-Investment-Manager fortlaufend Unternehmen mit einem unterdurchschnittlichen oder schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, um zu verstehen, wie sie besagte ESG-Bedenken mildern/verbessern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,2	100 %
Daten von Dritten	6,6	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 5,73 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 91 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen

(„**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

--- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

--- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.



*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	8,1 %	USA
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	6,6 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	5,4 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,2 %	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,8 %	USA
S&P GLOBAL INC	J – Information und Kommunikation	3,1 %	USA
TJX INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,5 %	USA
MASTERCARD INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,5 %	USA
CME GROUP INC CLASS A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	USA
VISA INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	USA
SALESFORCE INC	J – Information und Kommunikation	2,3 %	USA
CDW CORP	J – Information und Kommunikation	2,3 %	USA
SERVICENOW INC	J – Information und Kommunikation	2,3 %	USA
COSTCO WHOLESALE CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,2 %	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,2 %	USA

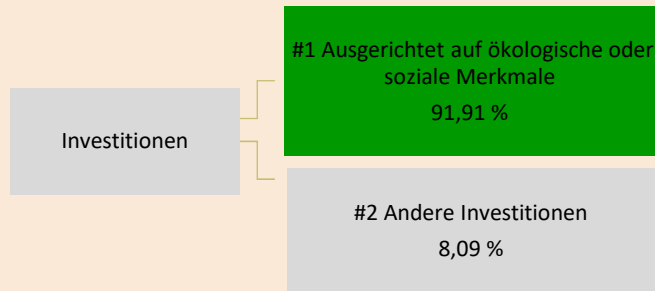


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	22,87 %
D – Energieversorgung	2,29 %
E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	1,89 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	13,30 %
H – Verkehr und Lagerei	2,15 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,09 %

J – Information und Kommunikation	37,68 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	13,17 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,40 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,16 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

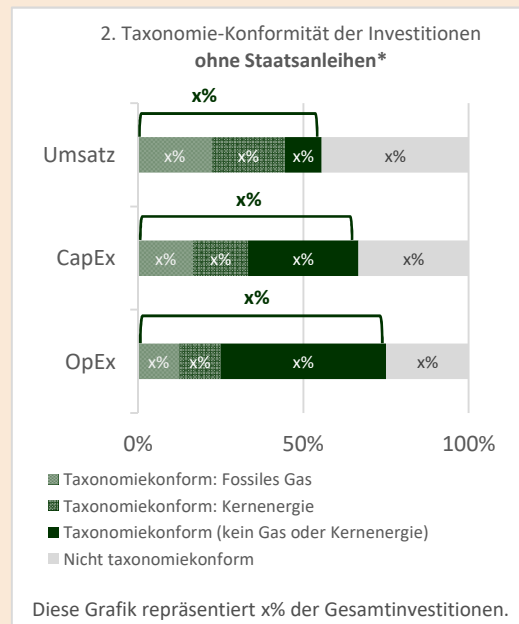
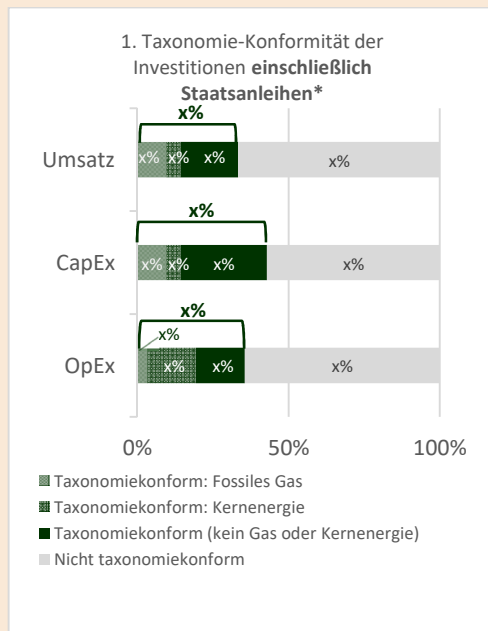
- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (das NB-ESG-Quotient- und externe Rating) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Unternehmen mit einem günstigen oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn das betreffende Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem des Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses für das Long-Segment. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.





**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300J88053TDGDPM52

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,0	100 %
Daten von Dritten	6,76	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 18,51 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 96 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise

seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— — **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— — **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
EXXON MOBIL CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,3 %	USA
JPMORGAN CHASE	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,4 %	USA
CHEVRON CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
MERCK & CO INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
PROCTER & GAMBLE	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	USA
BANK OF AMERICA CORP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,6 %	USA
NEWMONT	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,6 %	USA
JOHNSON & JOHNSON	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	USA
PFIZER INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	USA
RIO TINTO ADR REPTG ONE PLC	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,3 %	Australien
CUMMINS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %	USA
CONSTELLATION BRANDS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %	USA

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	USA
NEXTERA ENERGY INC	D – Energieversorgung	2,2 %	USA
BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,1 %	USA

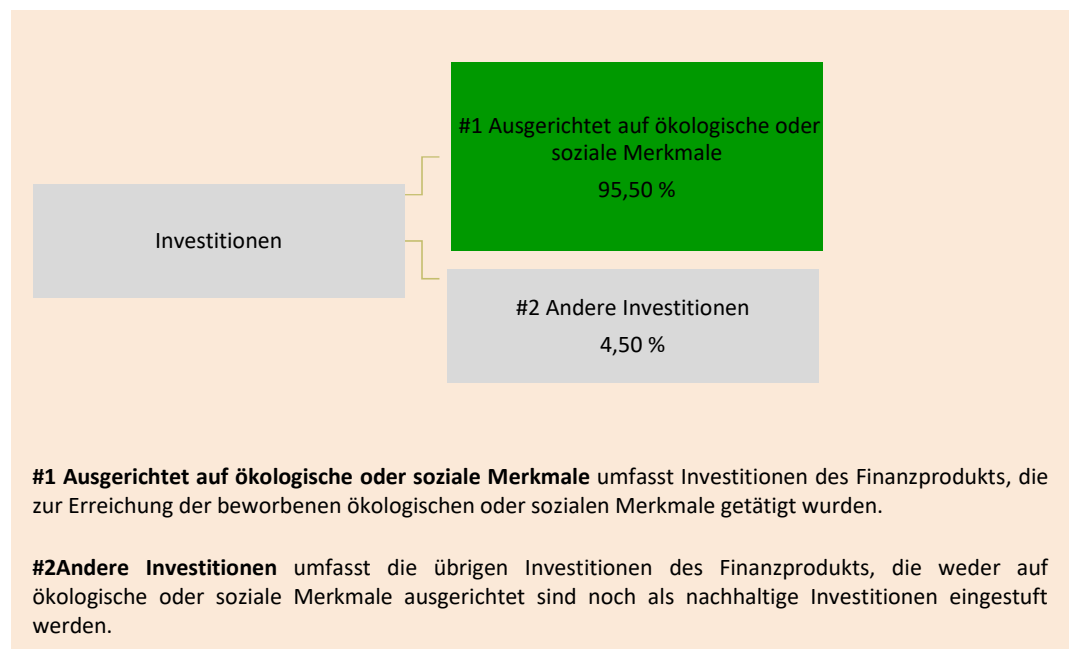


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

**Stand der Daten: 31. Dezember 2022**

<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	9,02 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	51,53 %
D – Energieversorgung	10,26 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,07 %
H - Verkehr und Lagerei	0,76 %
J – Information und Kommunikation	2,72 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	22,16 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,80 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,68 %



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

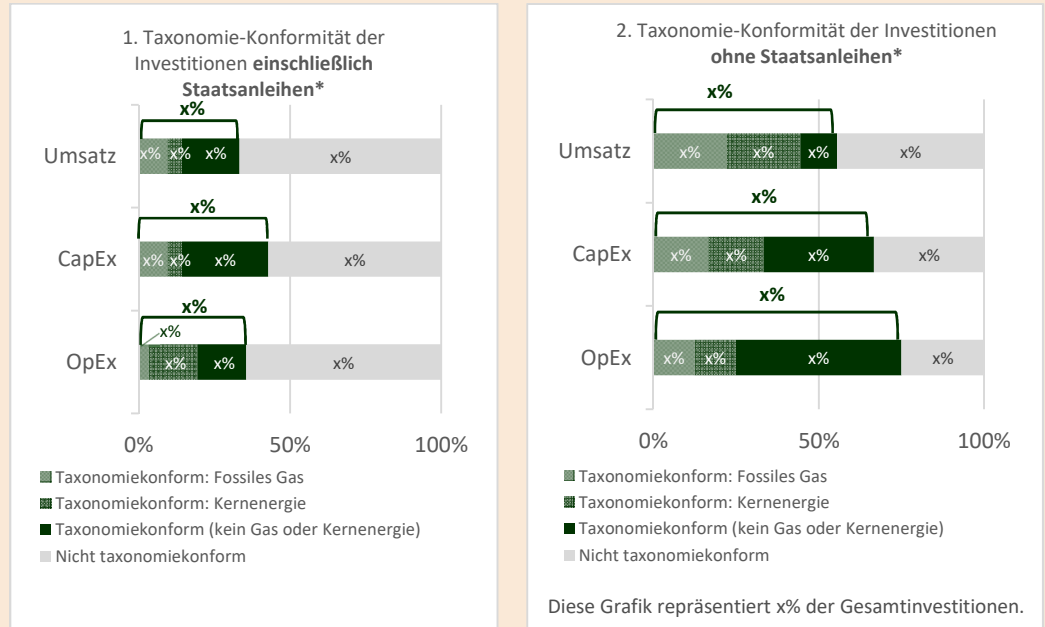
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Die Benchmark des Portfolios wurde nicht als Referenzwert bestimmt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300XPW2SIPQYGFT52

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor in den Schwellenländern angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen in Schwellenländern im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Durch die Integration lokaler Erkenntnisse in die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB nutzte der Sub-Investment-Manager die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB und passte die wesentlichen ESG-Merkmale an, um sicherzustellen, dass sie den Schwellenländern Rechnung trugen. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB berücksichtigte die langfristigen ESG-Merkmale umfassend, welche die Entwicklung der Branchen und Unternehmen in den Schwellenländern betrafen, und identifizierte Unternehmen, die in den Schwellenländern als Werttreiber fungierten.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,0	95 %
Daten von Dritten	5,6	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 28,80 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 91 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die

Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k. A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.



*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	6,9 %	Taiwan (Republic of China)
TENCENT HOLDINGS LTD	J – Information und Kommunikation	5,9 %	China
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,8 %	Korea (South), Republic of
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,4 %	China
ICICI BANK LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,9 %	Indien
JD.COM CLASS A INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,4 %	China
RELIANCE INDUSTRIES LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,0 %	Indien
HDFC BANK LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,7 %	Indien
STATE BANK OF INDIA	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,7 %	Indien
LG CHEM LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,6 %	Korea (South), Republic of
SAUDI ARABIAN OIL	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,5 %	Saudi-Arabien
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,5 %	Taiwan (Republic of China)
WALMART DE MEXICO V	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,5 %	Mexiko
KWEICHOW MOUTAI LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,4 %	China
ANGLO AMERICAN PLC	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,4 %	Südafrika

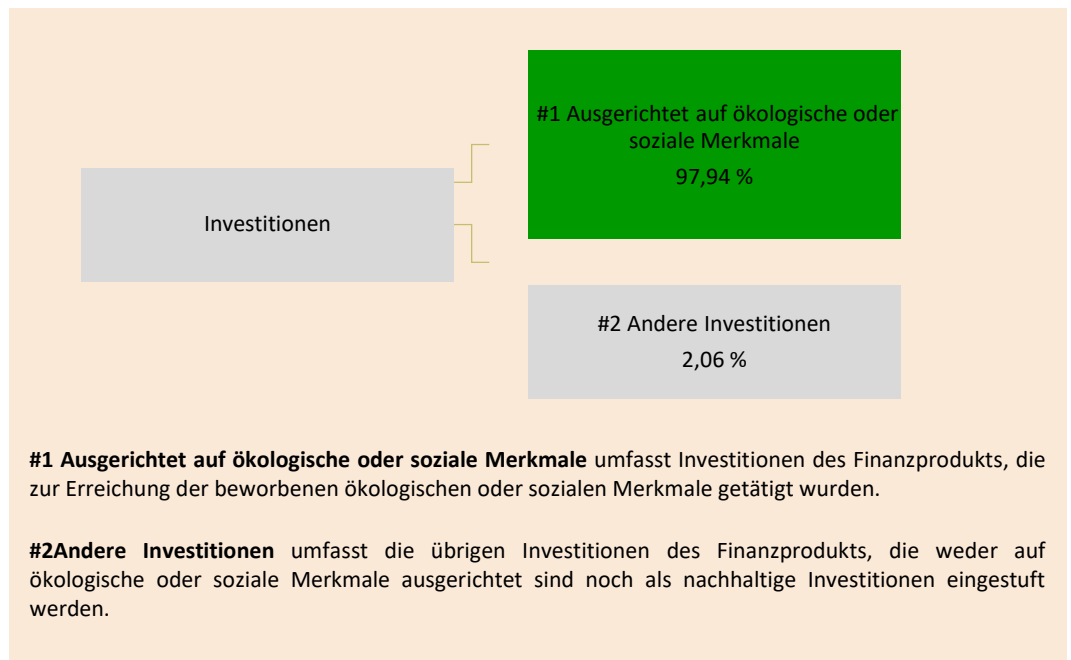


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	4,76 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	40,40 %
F – Baugewerbe/Bau	0,30 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	13,54 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,31 %
J – Information und Kommunikation	10,91 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	24,15 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,34 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,74 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,86 %
Keine	0,69 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

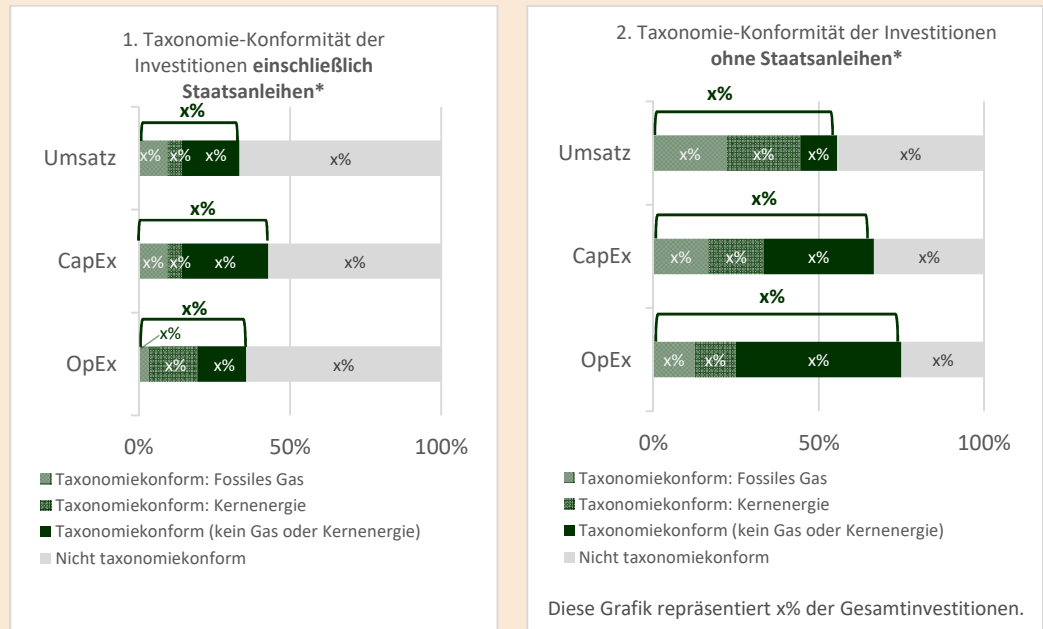
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wird herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn das betreffende Unternehmen keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300KP5UMDNHRQH875

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

Um das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, verringerte und verringert der Sub-Investment-Manager kontinuierlich den CO<sub>2</sub>-Fußabdruck des Portfolios in den Scope-1-, Scope-2- und wesentlichen Scope-3-THG-Emissionen, bis 2030 eine Verringerung um 50 % im Vergleich zu einem als Basiswert angenommenen Jahr (2019) und anschließend ein Rückgang auf Netto-Null bis 2050 erreicht werden. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor in den Schwellenländern angesehen werden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen in Schwellenländern im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Durch die Integration lokaler Erkenntnisse in die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB nutzte der Sub-Investment-Manager die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB und passte die wesentlichen ESG-Merkmale an, um sicherzustellen, dass sie den Schwellenländern Rechnung trugen. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB berücksichtigte die langfristigen ESG-Merkmale umfassend, welche die Entwicklung der Branchen und Unternehmen in den Schwellenländern betrafen, und identifizierte Unternehmen, die in den Schwellenländern als Werttreiber fungierten.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: A G: 2,0	95 %
Daten von Dritten	5,8	

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0 bis 10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 28,58 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 92 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen

Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

### ● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

#### *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

k. A.

#### *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fällt, die für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C – Fertigung	8,0 %	Taiwan (Republic of China)
TENCENT HOLDINGS LTD	J – Information und Kommunikation	6,1 %	China
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	C – Fertigung	4,4 %	Korea (South), Republic of
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,6 %	China
ICICI BANK ADR REP LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,5 %	Indien
JD.COM CLASS A INC	G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,0 %	China
RELIANCE INDUSTRIES LTD	C – Fertigung	2,5 %	Indien
HDFC BANK ADR REPRESENTING THREE L	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,8 %	Indien
KWEICHOW MOUTAI LTD A	C – Fertigung	1,7 %	China
WALMART DE MEXICO V	G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,7 %	Mexiko
DINO POLSKA SA	G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,6 %	Polen
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,6 %	Taiwan (Republic of China)
LG CHEM LTD	C – Fertigung	1,5 %	Korea (South), Republic of
SK HYNIX INC	C – Fertigung	1,5 %	Korea (South), Republic of
ANGLO AMERICAN PLC	B – Bergbau und Steine & Erden	1,5 %	Südafrika

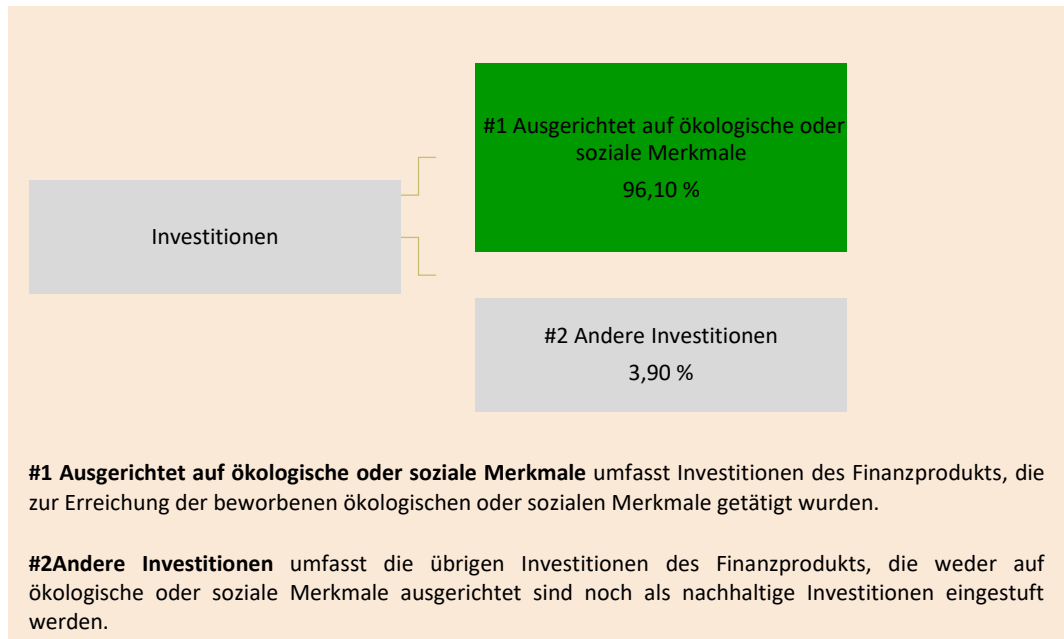


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,54 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	40,58 %
D – Energieversorgung	0,88 %
F – Baugewerbe/Bau	0,46 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	14,96 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,48 %
J – Information und Kommunikation	10,88 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	25,89 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,44 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,35 %
Keine	0,53 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

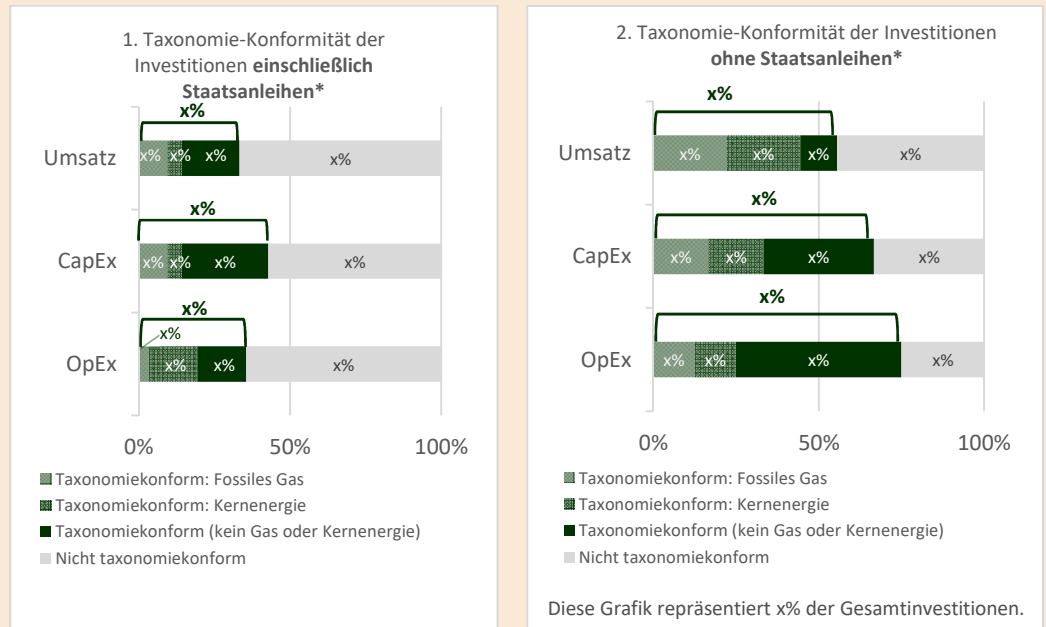
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wird herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn das betreffende Unternehmen keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300ELGQMFUUPHG878

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit der hausinternen NB-ESG-Bewertung gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung:

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte als Teil des Anlageprozesses verschiedene ökologische und soziale Merkmale für sein Bewertungsmodell. Der Sub-Investment-Manager griff auf eine hausinterne ESG-Bewertung von Neuberger Berman („NB“) zurück, der an den japanischen Markt angepasst wurde. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung berücksichtigte in ihrem Bewertungsmodell außerdem das Mitwirkungspotenzial. Ferner berücksichtigte die hausinterne NB-ESG-Bewertung die von der Wesentlichkeitsmatrix von NB identifizierten ökologischen und sozialen Merkmale, die auf dem Wesentlichkeitsrahmen des Sustainability Accounting Standards Board („SASB“) basieren. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden.

Grundlage für die hausinterne NB-ESG-Bewertung von NB ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird.

Die hausinterne NB-ESG-Bewertung gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon eine hausinterne NB-ESG-Bewertung für Unternehmen abzuleiten, die im Portfolio gehalten werden. Unternehmen mit einer günstigen und/oder sich verbessernden hausinternen NB-ESG-Bewertung erhalten eine höhere Punktzahl, was bei der Erhöhung der Gewichtung der Unternehmen im Portfolio ein wesentlicher Gesichtspunkt war. Unternehmen mit einer schlechten hausinternen NB-ESG-Bewertung, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit mit einer niedrigeren Bewertung versehen, wodurch die Gewichtung eines Unternehmens im Portfolio verringert werden konnte. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei im Portfolio gehaltenen Unternehmen Vorrang einzuräumen, um deren Bemühungen bei der Bewältigung wesentlicher Belange zu unterstützen, die der Sub-Investment-Manager für die unternehmerischen Fundamentaldaten und das langfristige Wachstum des Unternehmens, einschließlich ökologischer und sozialer Belange als ausschlaggebend erachtete.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
Interne NB-ESG-Bewertung	ES: 8,05 G: 8,48	100 %
Daten von Dritten	5,1	

Im Hinblick auf die hausinterne NB-ESG-Bewertung wurde ein separates Rating zwischen 1 und 15 für ökologische und soziale Merkmale (ES) sowie zur Bewertung der Governance (G) verwendet, wobei 15 dem höchsten und 1 dem niedrigsten Rating entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine hausinterne NB-ESG-Mindestbewertung. Das durchschnittliche Rating der hausinternen NB-ESG-Bewertung ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 20,70 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 90 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und ab dem 28. November 2022 gegen die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstießen oder

nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus der hausinternen NB-ESG-Bewertung und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k. A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.



*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
OKINAWA CELLULAR TELEPHONE	J – Information und Kommunikation	5,3 %	Japan
RICOH LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,0 %	Japan
SHOEI LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,0 %	Japan
TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	F – Baugewerbe/Bau	4,3 %	Japan
PILOT CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	Japan
YAMAHA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	Japan
DAIWA INDUSTRIES LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,4 %	Japan
MUSASHI SEIMITSU INDUSTRY LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	Japan
OPEN UP GROUP INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,2 %	Japan
AMADA LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,2 %	Japan
USS LTD	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,8 %	Japan
HOKKOKU FINANCIAL HOLDINGS INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,5 %	Japan
AS ONE CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,3 %	Japan
NIFCO INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %	Japan
RESORT TRUST INC	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,3 %	Japan

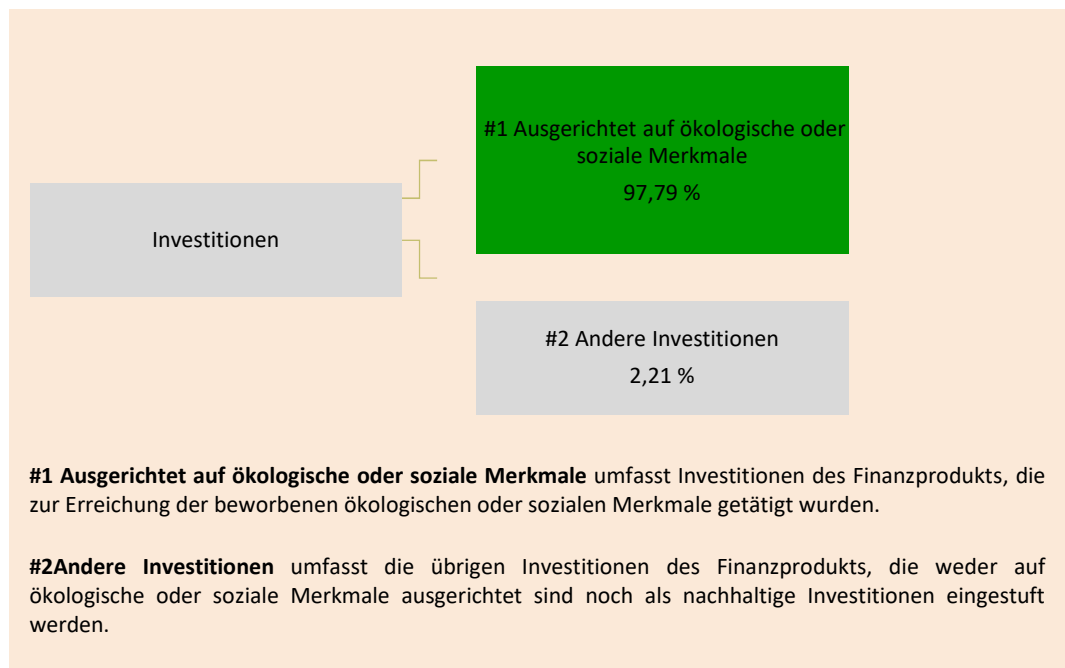


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder eine hausinterne NB-ESG-Bewertung oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	44,18 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	2,65 %
F – Baugewerbe/Bau	5,86 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	7,31 %
H – Verkehr und Lagerei	0,95 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,32 %
J – Information und Kommunikation	15,59 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	9,02 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,58 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,88 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	4,28 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,63 %
Keine	0,74 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

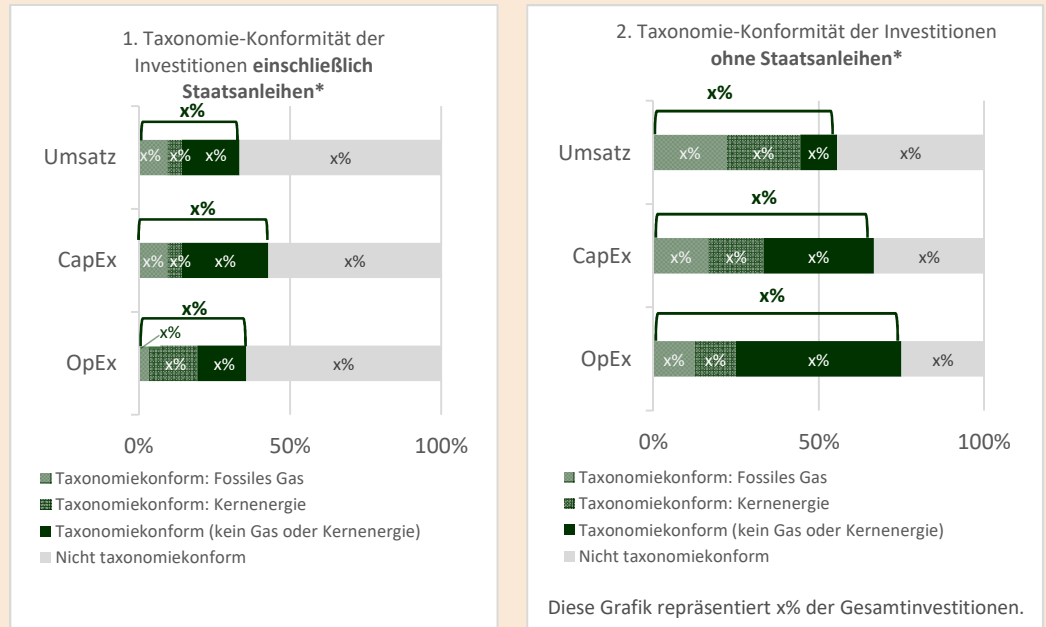
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Für Belange der ökologischen und sozialen Verantwortlichkeit verfolgte der Sub-Investment-Manager über die hausinterne NB-ESG-Bewertung einen Top-down-Ansatz. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung nutzte die Wesentlichkeitsmatrix von NB, um diejenigen Nachhaltigkeitsfaktoren zu identifizieren, die eine wesentliche Auswirkung auf die Nachhaltigkeit des Unternehmens gehabt haben könnten. Anschließend analysierte der Sub-Investment-Manager diese Belange im Hinblick auf das Geschäftsmodell, die Wertschöpfungskette, die Wachstumsphase des jeweiligen Unternehmens und dessen Wettbewerbsposition, um vorrangige Probleme zu identifizieren, die umgehend angegangen werden mussten. Dies geschah anhand von Recherchen vor Ort, bei der über mehrere Jahre öffentlich zugängliche Unternehmensinformationen durchforstet wurden, sowie Gesprächen mit dem Unternehmen, Konkurrenten, Lieferanten, Kunden und externen Researchanbietern, sofern durchführbar.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Sobald das Portfolio in ein Unternehmen investiert hat, setzt der Sub-Investment-Manager ein Mitwirkungsziel und eine individuelle Strategie fest, um die im Rahmen des Bewertungsprozesses identifizierten wesentlichen Belange finanzieller Art anzugehen. Die Zusammenarbeit des Sub-Investment-Managers mit Portfoliobeständen zielte darauf ab, diesen Unternehmen zu helfen, ein langfristiges Wachstum zu generieren. Als langfristiger Anleger mit Fokus auf die Bottom-up-Aktienauswahl war der Sub-Investment-Manager der Ansicht, dass er mittels eines tiefgreifenden Dialogs über das Kapitalmanagement, Umwelt- und Sozialthemen von finanzieller Wesentlichkeit sowie die Corporate Governance das jeweilige Unternehmen dabei unterstützte, ein langfristiges Wachstumsprofil aufrechtzuerhalten, was letztlich einen Performancebeitrag für das Portfolio leistete. Die Erfahrung des Sub-Investment-Managers bei der Zusammenarbeit mit Unternehmen zeigt, dass kleinere Unternehmen mehr Zeit und Ressourcen zur Bewältigung dieser Themen in Anspruch nehmen (im Durchschnitt zwei bis drei Jahre für Umwelt- und Sozialthemen). In Anbetracht dieses relativ langwierigen Prozesses führte der Sub-Investment-Manager ein System der Meilensteine ein, um sicherzustellen, dass die Mitwirkung weiterhin das gewünschte Ziel erbringt.

### **III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.



**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300T9PUOV1AK0OR82

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 1	100 %
Daten von Dritten	6,2	

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 9,79 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 93 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch

solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ab dem 28. November 2022 untersagte der Sub-Investment-Manager Investitionen in Emittenten, die private Gefängnisse besitzen, betreiben oder überwiegend wesentliche Dienstleistungen für diese erbringen. Die Gründe sind die erheblichen sozialen Kontroversen, die Reputationsrisiken, die Abhängigkeit von der Politik der Justizministerien und der Umstand, dass diese Einrichtungen nicht ohne weiteres für andere Zwecke umgestaltet werden können.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

— — **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

— — **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMERICAN TOWER REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	8,8 %	USA
PROLOGIS REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	8,0 %	USA
PUBLIC STORAGE REIT	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	6,3 %	USA
CROWN CASTLE INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	6,1 %	USA
REALTY INCOME REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,2 %	USA
WELLTOWER	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,1 %	USA
DIGITAL REALTY TRUST REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,5 %	USA
EQUINIX REIT INC	J – Information und Kommunikation	3,3 %	USA
KIMCO REALTY REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %	USA
SIMON PROPERTY GROUP REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %	USA
IRON MOUNTAIN INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %	USA
ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %	USA
SUN COMMUNITIES REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,8 %	USA
EQUITY RESIDENTIAL REIT	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,8 %	USA
SBA COMMUNICATIONS REIT CORP CLASS	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,8 %	USA

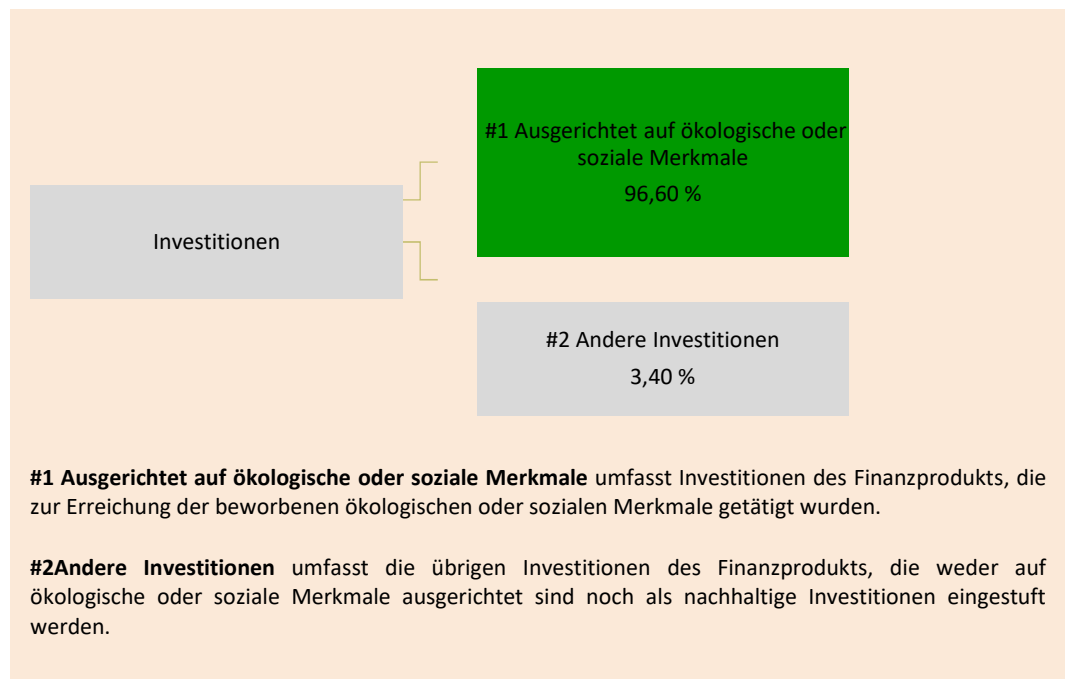


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,03 %
J – Information und Kommunikation	3,37 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,61 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	86,67 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	6,31 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

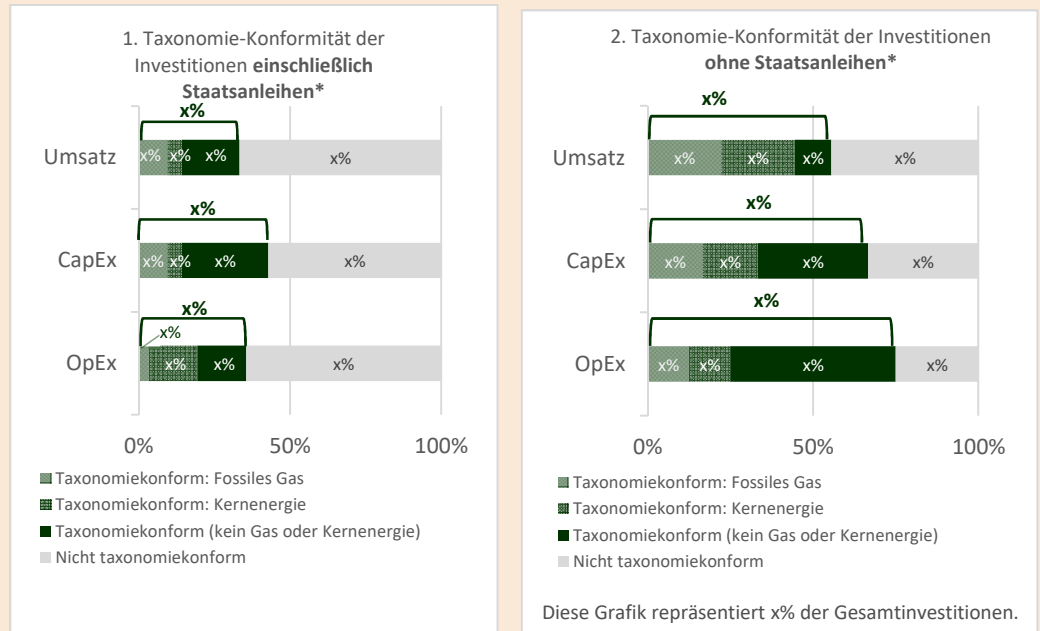
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Emittenten erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Emittenten bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht sie nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300JYOIU4VRI67006

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet. Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

	Rating	Kombinierte Abdeckung
<b>31. Dezember 2022</b>		
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2	100 %
Daten von Dritten	6,4	

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 15,90 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 94 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden können, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die

Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen werden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ab dem 28. November 2022 untersagte der Sub-Investment-Manager Investitionen in Emittenten, die private Gefängnisse besitzen, betreiben oder überwiegend wesentliche Dienstleistungen für diese erbringen. Die Gründe sind die erheblichen sozialen Kontroversen, die Reputationsrisiken, die Abhängigkeit von der Politik der Justizministerien und der Umstand, dass diese Einrichtungen nicht ohne weiteres für andere Zwecke umgestaltet werden können.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PROLOGIS REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	5,3 %	USA
AMERICAN TOWER REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	5,1 %	USA
PUBLIC STORAGE REIT	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	3,6 %	USA
CROWN CASTLE INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen	3,2 %	USA
UOL GROUP LTD	F – Baugewerbe/Bau	2,9 %	Singapur
MITSUI FUDOSAN LTD	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,8 %	Japan
WELLTOWER	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,7 %	USA
CK ASSET HOLDINGS LTD	F – Baugewerbe/Bau	2,3 %	Hongkong
MITSUI FUDOSAN LOGISTICS PARK REIT	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,3 %	Japan
LASALLE LOGIPOINT REIT	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,2 %	Japan
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT UNIT	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,2 %	Kanada
REALTY INCOME REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,2 %	USA
SEGRO REIT PLC	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,1 %	Großbritannien
MITSUBISHI ESTATE LTD	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,1 %	Japan
KIMCO REALTY REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnunswesen	2,0 %	USA

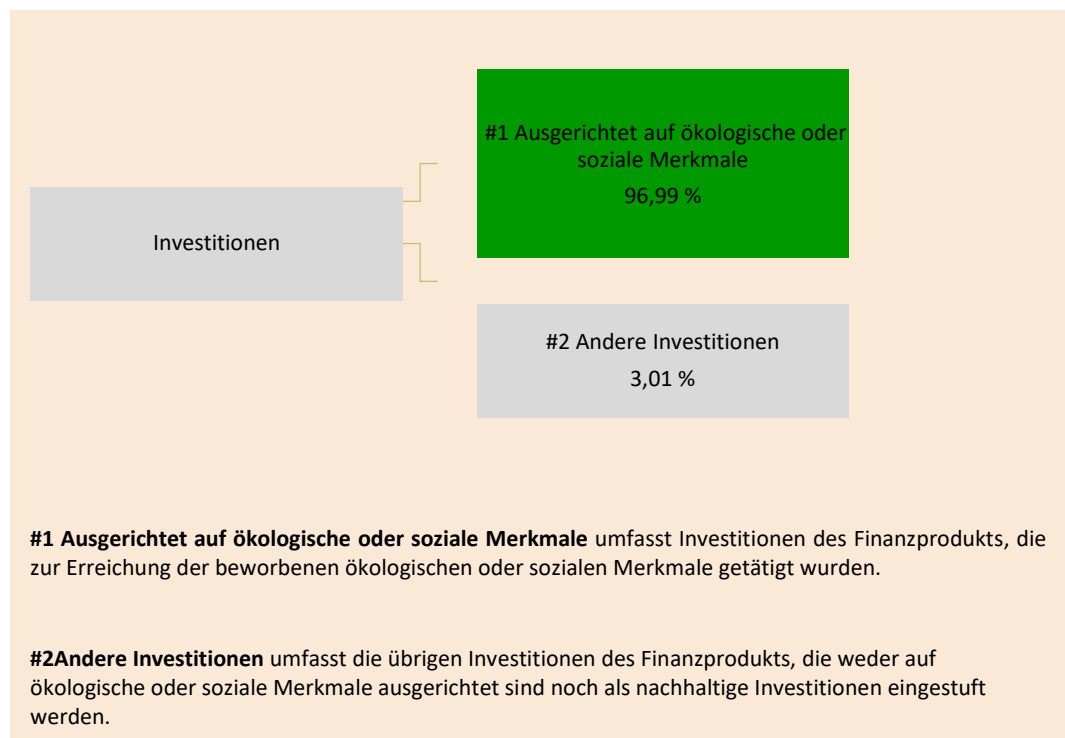


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,94 %
F – Baugewerbe/Bau	9,46 %
J – Information und Kommunikation	3,99 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,85 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	81,46 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,30 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

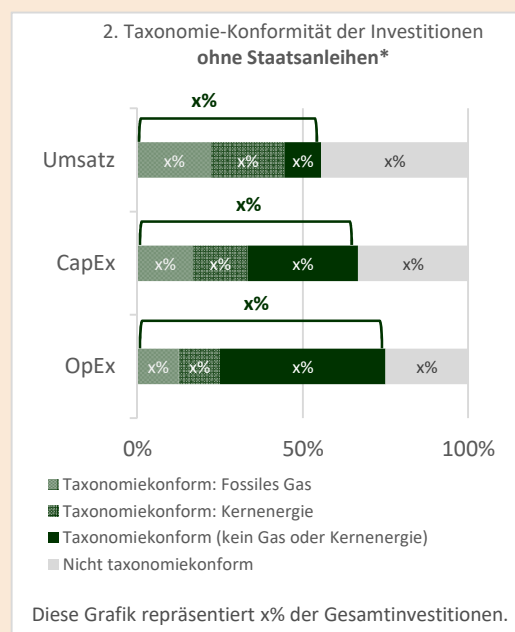
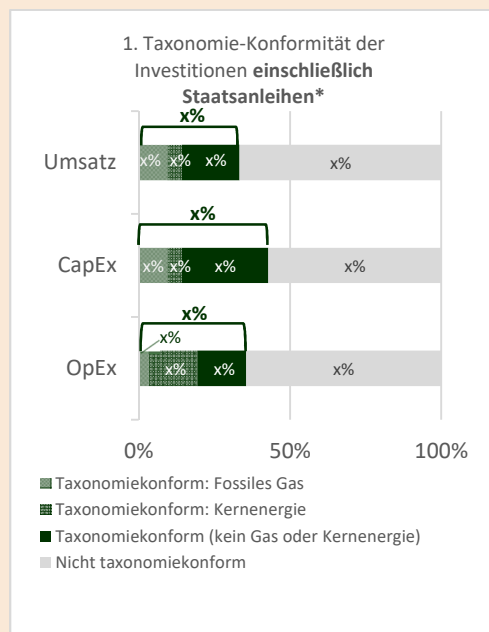
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte. Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Emittenten erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Emittenten bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---



**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 54930037QMZTCH4D7291

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, Energiemanagement, Umweltpolitik, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Cybersicherheitssystem und -schulungen, Qualitätsmanagement, Gesundheit und Arbeitsbedingungen und Arbeitsunfälle, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement und Preistransparenz.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Der Sub-Investment-Manager griff auf die Wesentlichkeitsmatrix von NB und lokalen Erkenntnisse zum chinesischen Markt zurück, um die wesentlichen ESG-Merkmale für chinesische A-Aktien anzupassen. Im Hinblick auf chinesische A-Aktien bewertete der Sub-Investment-Manager die langfristigen ESG-Merkmale und Werttreiber der Branchen Chinas und der darin tätigen Unternehmen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	BBB	92 %
Daten von Dritten	4	

Für den NB-ESG-Quotient wird ein Rating zwischen CCC und AA verwendet, wobei CCC das niedrigste und AA das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der

Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandels pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 23,70 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügt. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 94 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und ab dem 19. August 2022 gegen die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k. A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 hat der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen berücksichtigt, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
KWEICHOW MOUTAI LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	7,4 %	China
BANK OF NINGBO LTD A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	6,1 %	China
WULIANGYE YIBIN LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	China
PING AN INSURANCE (GROUP) OF CHINA	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,0 %	China
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECT	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,9 %	China
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	China
MIDEA GROUP LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	China
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY LT	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %	China
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROU	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,9 %	China
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %	China
MEITUAN	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,7 %	China
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GRO	F – Baugewerbe/Bau	2,6 %	China
SANY HEAVY INDUSTRY LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	China
CHINA MERCHANTS BANK LTD A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	China
TENCENT HOLDINGS LTD	J – Information und Kommunikation	2,2 %	China

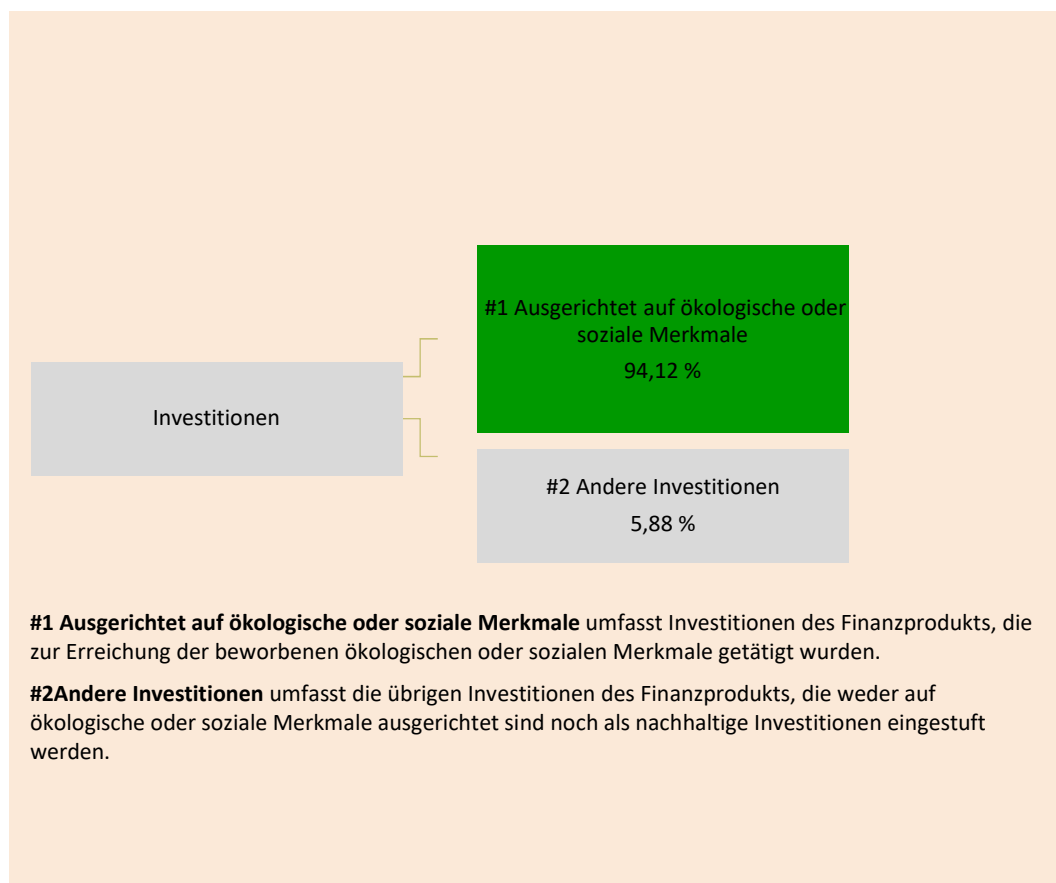


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	64,95 %
D – Energieversorgung	1,33 %
F – Baugewerbe/Bau	2,79 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	6,28 %
J – Information und Kommunikation	5,68 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	14,38 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,53 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,06 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:  In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

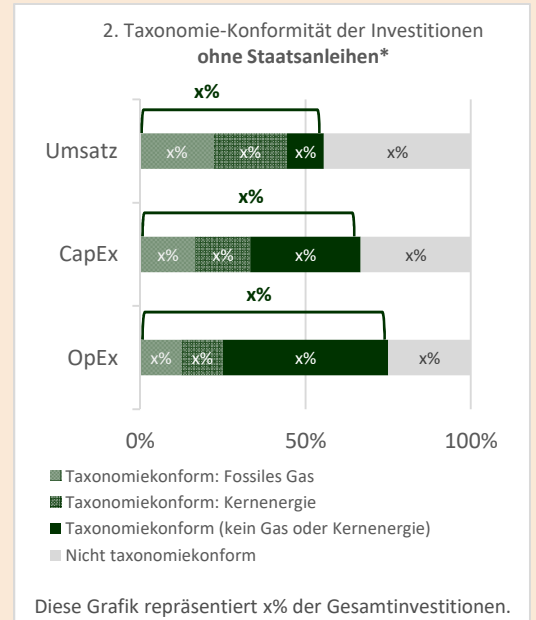
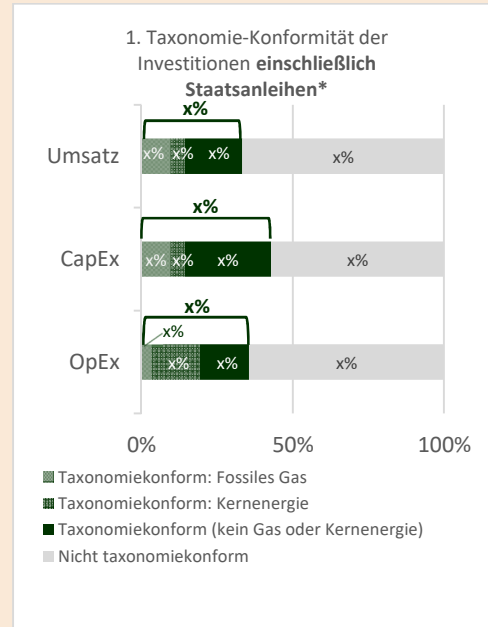
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen lokalen Erkenntnisse zum chinesischen Markt und ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn das betreffende Unternehmen keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

### **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

- 
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
  - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300H0HOXG52ES7840

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und <ul style="list-style-type: none"> <li>obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 65,26 %* an nachhaltigen Investitionen</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,7	100 %
Daten von Dritten	6,5	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 2,63 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 97 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman

Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD - Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.



Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens des Sub-Investment-Managers wurden Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: TH-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen und Beteiligungen an umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Ab dem 6. April 2022 investierte der Sub-Investment-Manager nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die beabsichtigten nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

### ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Ab dem 6. April 2022 investierte der Sub-Investment-Manager nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die

Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- i. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
- ii. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, nämlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die

UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	USA
ADVANCED MICRO DEVICES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,8 %	USA
ASM INTERNATIONAL NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	Niederlande
SERVICENOW INC	J – Information und Kommunikation	3,7 %	USA
MARVELL TECHNOLOGY INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	USA
HUBSPOT INC	J – Information und Kommunikation	3,6 %	USA
NOKIA ADR REPRESENTING ONE SERIES	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	Finland
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	China
T MOBILE US INC	J – Information und Kommunikation	3,3 %	USA
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	Taiwan (Republic of China)
ADVANTEST CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,1 %	Japan
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
SG MICRO CORP A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	China
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	J – Information und Kommunikation	2,6 %	USA
WOLFSPEED INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	USA

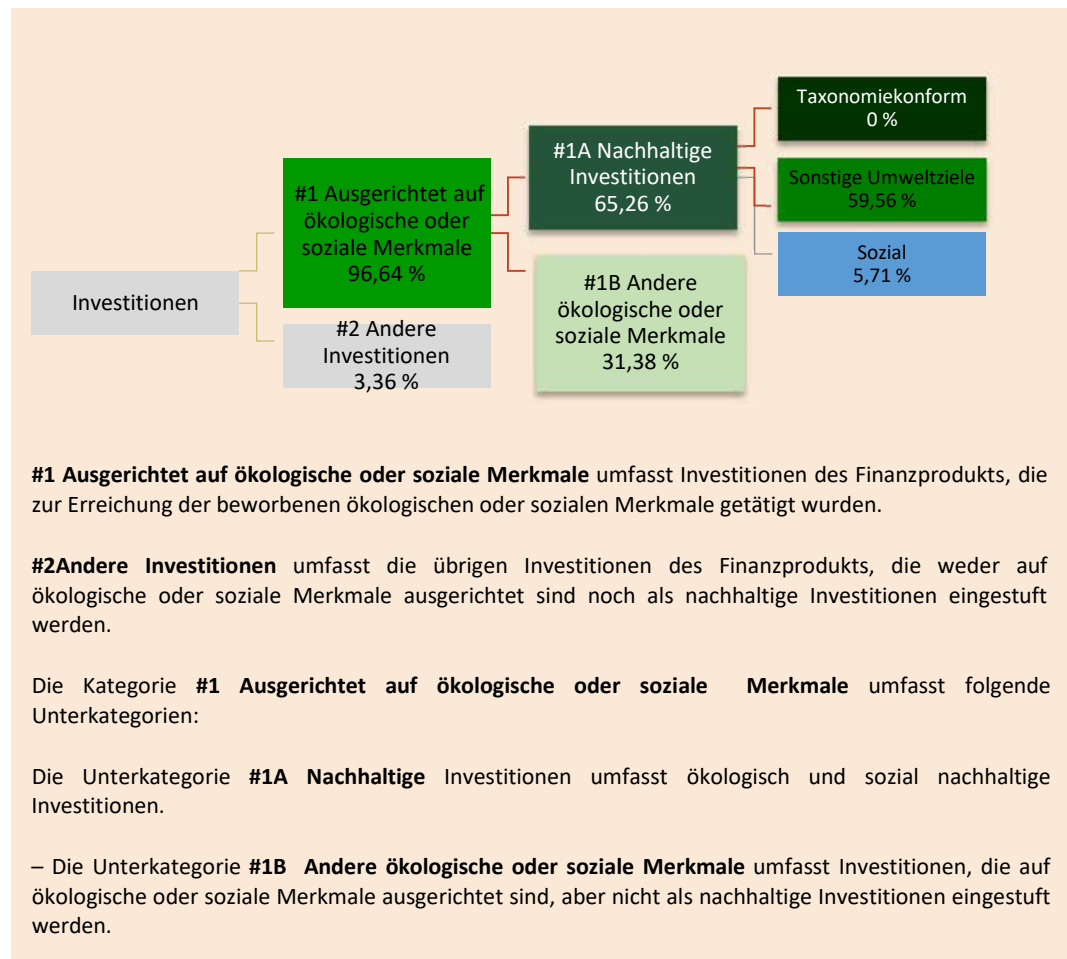


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.



**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	59,19 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,82 %
J – Information und Kommunikation	35,28 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,55 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,09 %
P – Erziehung und Unterricht	2,07 %

### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

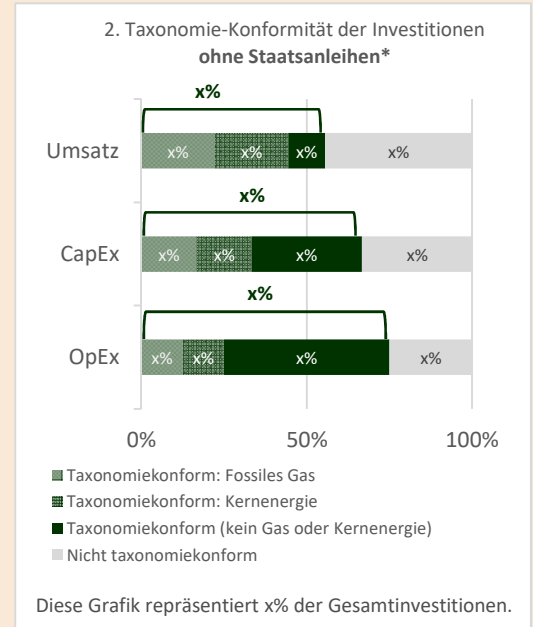
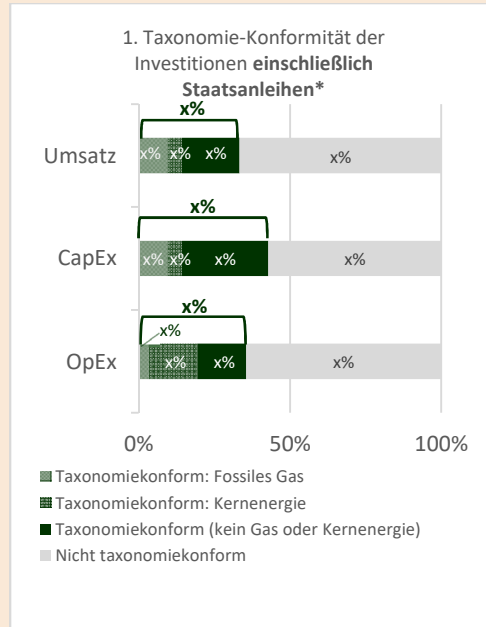
- Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

59,56 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

5,71 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Das NB-ESG-Quotient-Rating wurde für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Konnektivität der nächsten Generation fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes externes oder NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

---



- 
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300VMISY5R7FEHX25

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,98 %* an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale</b> beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Investitionen) im Sinne der EU-Taxonomie

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „NB-ESG-Quotient“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: C G: 2,2	86 %
Daten von Dritten	4,3	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 5,27 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 87 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren

Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD - Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens hat der Sub-Investment-Manager Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: TH-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen und Beteiligungen an umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Ab dem 6. April 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die beabsichtigten nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — —  
*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 investierte der Sub-Investment-Manager nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- i. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
- ii. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, nämlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SANSAN INC	J – Information und Kommunikation	3,8 %	Japan
HARMONIC DRIVE SYSTEMS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	Japan
EMEMORY TECHNOLOGY INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	Taiwan (Republic of China)
AEM HOLDINGS LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	Singapur
FABRINET	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,4 %	Thailand
JMDC INC	J – Information und Kommunikation	3,2 %	Japan
ACCTON TECHNOLOGY CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	Taiwan (Republic of China)
E INK HOLDINGS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	Taiwan (Republic of China)
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & EL	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	China
YAGEO CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	Taiwan (Republic of China)
HONGFA TECHNOLOGY LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %	China
SQUARE ENIX HLDG LTD	J – Information und Kommunikation	2,9 %	Japan
FPT CORP	J – Information und Kommunikation	2,7 %	Vietnam
CYBER AGENT INC	M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	2,7 %	Japan
TAIWAN MANUFACTURING	SEMICONDUCTOR C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,6 %	Taiwan (Republic of China)



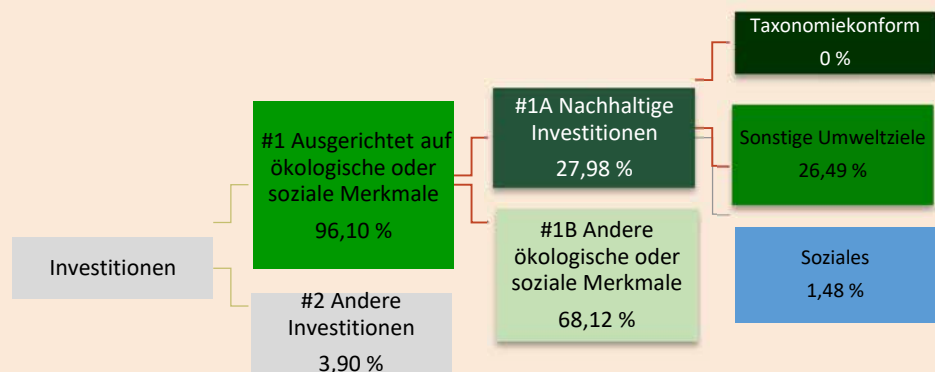


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

**Zum 31. Dezember 2022**

<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	70,00 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,53 %
J – Information und Kommunikation	20,28 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	4,18 %
P – Erziehung und Unterricht	2,21 %
Keine	1,81 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

#### **Ermöglichende Tätigkeiten**

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## **Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

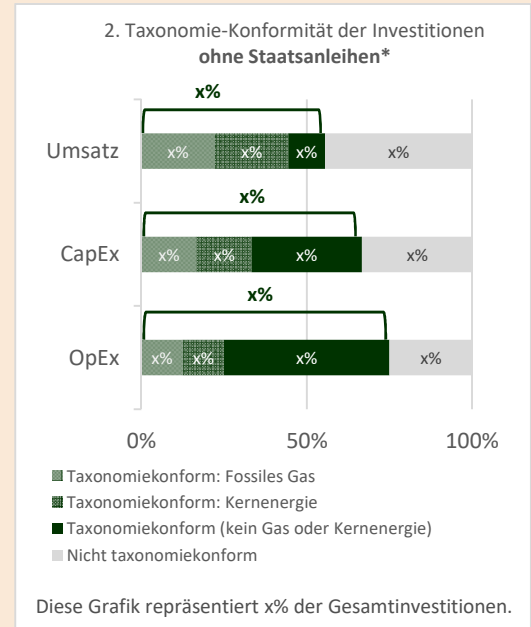
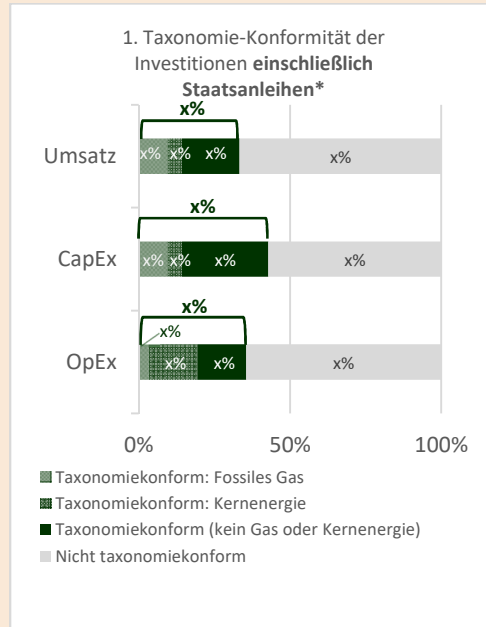
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

26,49 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

1,48 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Das NB-ESG-Quotient-Rating wurde für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Konnektivität der nächsten Generation fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes externes oder NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht sie nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

**Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493000YD3J3W1CMMU74

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 48,02 %\* an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.





## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Investitionen) im Sinne der EU-Taxonomie

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,2	99 %
Daten von Dritten	6,7	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 3,56 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 93 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6.

April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD - Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens des Sub-Investment-Managers wurden Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: TH-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen und Beteiligungen an umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Ab dem 6. April 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die beabsichtigten nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — —  
*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 investierte der Sub-Investment-Manager nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- i. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
- ii. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, nämlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ANALOG DEVICES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,1 %	USA
AMPHENOL CORP CLASS A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	USA
ANSYS INC	J – Information und Kommunikation	3,9 %	USA
CATERPILLAR INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
LINDE PLC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	Großbritannien
DEERE & CO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %	USA
TRIMBLE INC	J – Information und Kommunikation	2,8 %	USA
TE CONNECTIVITY LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	USA
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	USA
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	J – Information und Kommunikation	2,5 %	USA
MP MATERIALS CORP CLASS A	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,5 %	USA
GENTEX CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	USA
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	USA
RAMBUS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	USA
SCHNEIDER ELECTRIC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	Frankreich

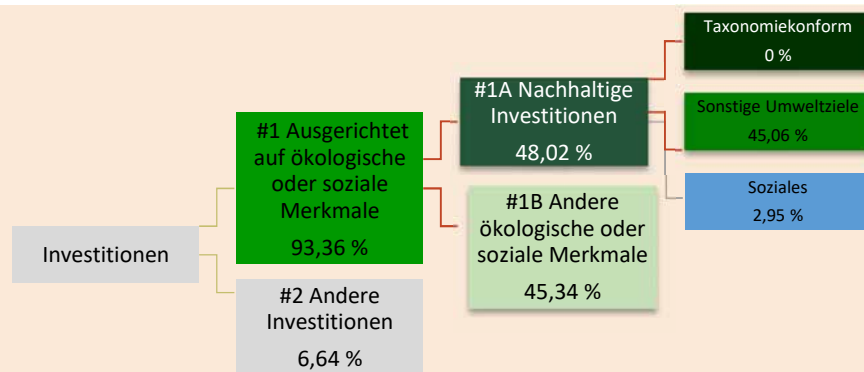


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

**Zum 31. Dezember 2022**

<b>Wirtschaftssektoren - NACE</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	3,07 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	72,40 %
D – Energieversorgung	0,42 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,88 %
J – Information und Kommunikation	19,68 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,11 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,10 %
Keine	0,33 %





Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

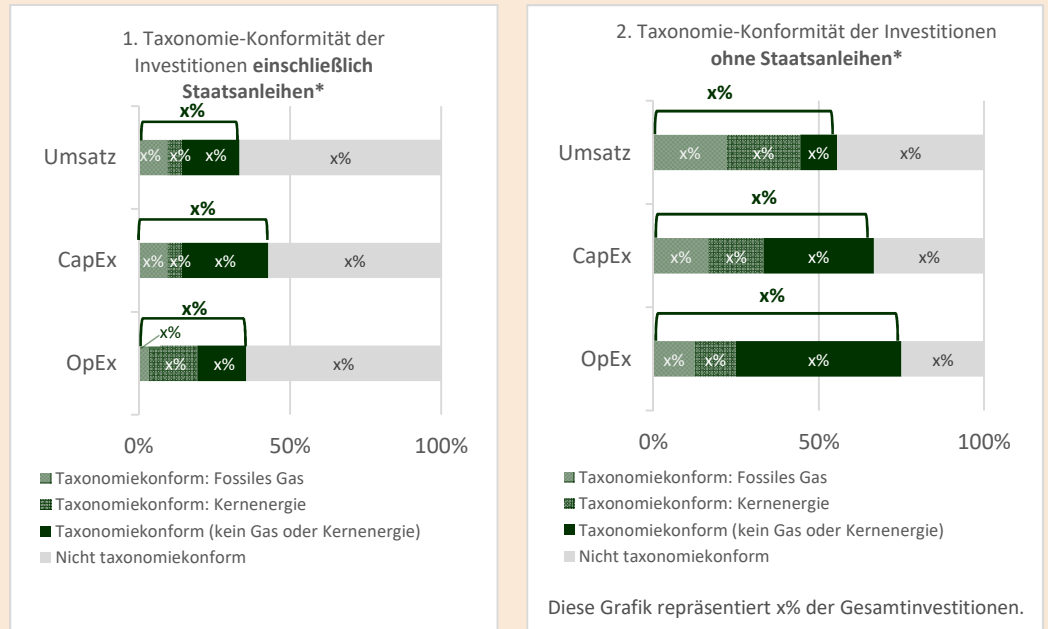
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

45,06 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

2,95 %



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale

Schutzmaßnahmen ergriffen wurden.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Konnektivität der nächsten Generation fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes externes oder NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

---

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300FT24ZYHNJCVO63

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> <b>wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und</b> obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,92 %* an nachhaltigen Investitionen  <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“)\*, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

\*In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.<sup>1</sup>

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

---

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

31. Dezember 2022	Rating	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,7	97 %
Daten von Dritten	6,2	

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandels pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 4,04 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 82 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement



Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielen oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens des Sub-Investment-Managers wurden Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: TH-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen und Beteiligungen an umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Ab dem 6. April 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die beabsichtigten nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 investierte der Sub-Investment-Manager nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- i. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
- ii. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, nämlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,7 %	USA
MOTOROLA SOLUTIONS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	USA
AIRBUS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	Frankreich
INTELLIAN TECHNOLOGIES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,4 %	Korea (South), Republic of
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	USA
PLANET LABS CLASS A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	USA
EUTELSAT COMMUNICATIONS SA	J – Information und Kommunikation	3,2 %	Frankreich
ROCKET LAB USA INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,2 %	USA
DEERE & CO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,2 %	USA
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,2 %	Singapur

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

LEIDOS HOLDINGS INC	J – Information und Kommunikation	3,0 %	USA
SAFRAN SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %	Frankreich
TRANSDIGM GROUP INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	USA
THALES SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	Frankreich
CACI INTERNATIONAL INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	2,7 %	USA

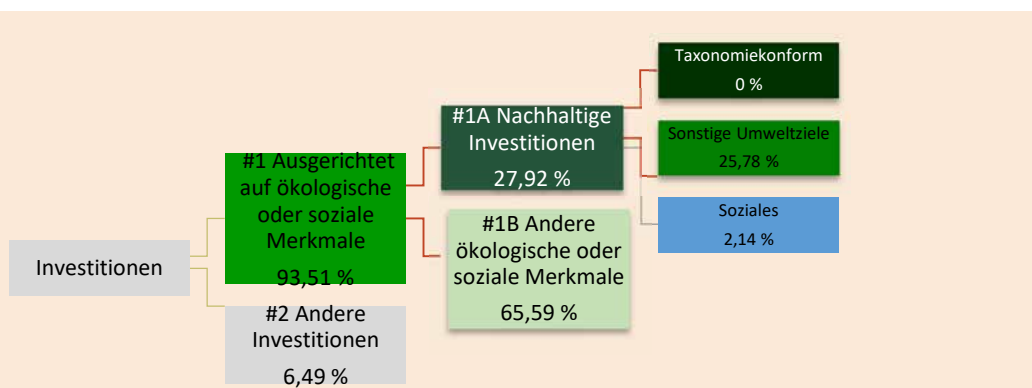


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.  
**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	69,93 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,02 %
J – Information und Kommunikation	26,18 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,87 %



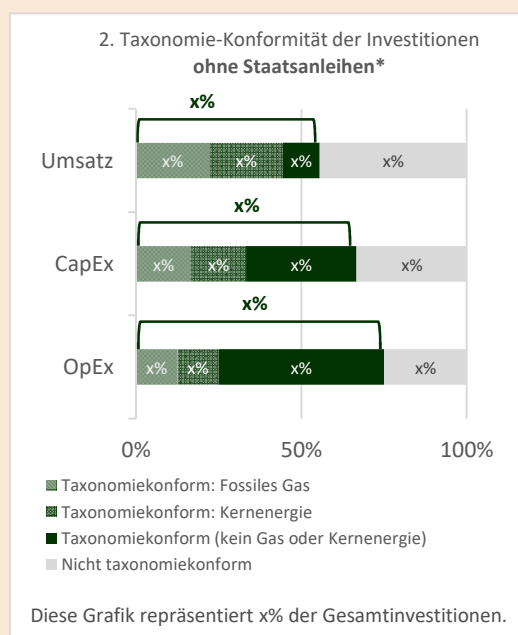
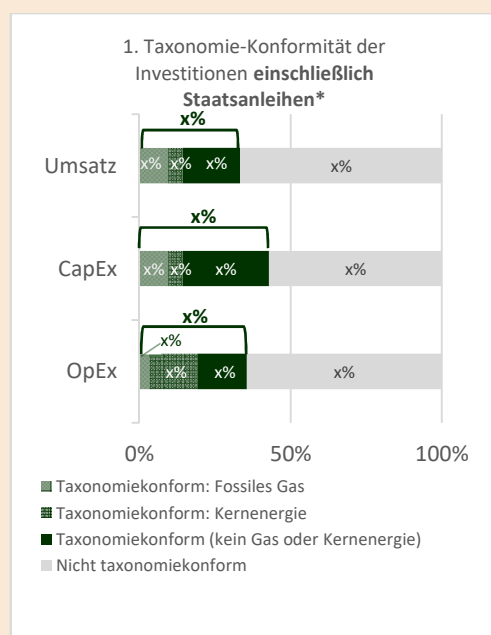
### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?**

- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxoniekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

25,78 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

2,14 %



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:



I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Konnektivität der nächsten Generation fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes externes oder NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300NOKC884YXB6S20

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität,



Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Investitionen ) im Sinne der EU-Taxonomie

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB- ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	ES: C G: 2,5	
Daten von Dritten	5,4	92 %

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 27,91 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 94 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen

die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

— — — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

k. A.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager seit dem 6. April 2022 nicht mehr in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Sub-Investment-Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf das Portfolio, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene hing von der Verfügbarkeit angemessener, zuverlässiger und überprüfbarer Daten für diese Indikatoren ab. Stehen solche Daten nicht zur Verfügung, werden die PAIs auf Produktebene erst dann berücksichtigt, wenn diese Daten verfügbar sind. Der Sub-Investment-Manager wird die Liste der von ihm berücksichtigten PAIs auf Produktebene einer aktiven Überprüfung unterziehen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	6,2 %	Kanada
ALIBABA GROUP HOLDING ADR	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	6,1 %	China
REPRESN PAYA HOLDINGS INC CLASS A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	5,9 %	USA
CRITEO ADR	M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	5,6 %	Frankreich
REPRESENTING SA	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,6 %	Großbritannien
PETS AT HOME PLC	S – Sonstige Dienstleistungen	5,2 %	USA
PERRIGO PLC	E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	4,9 %	USA
STERICYCLE INC	J – Information und Kommunikation	4,9 %	USA
SCHOLASTIC CORP	H – Verkehr und Lagerei	4,8 %	USA
DELTA AIR LINES INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	4,7 %	USA
EXPEDIA GROUP INC	J – Information und Kommunikation	4,6 %	USA
AMDOCS LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,6 %	USA
CORNING INC	H – Verkehr und Lagerei	4,4 %	USA
MODIVCARE INC	D – Energieversorgung	4,1 %	USA
VISTRA CORP	J – Information und Kommunikation	4,1 %	USA
ALPHABET INC CLASS A			

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

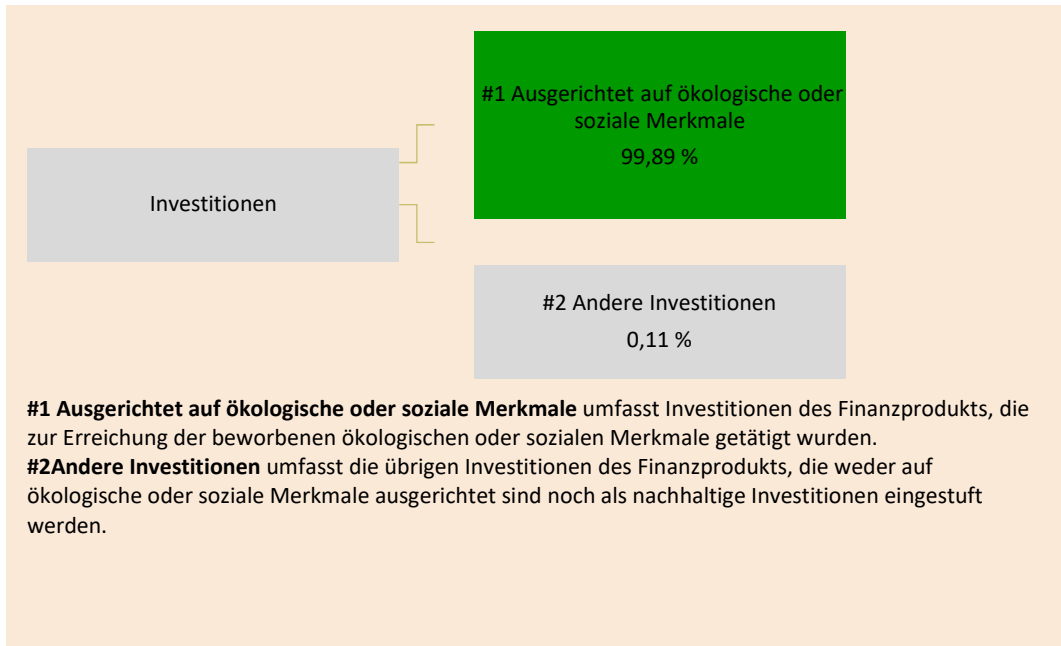


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	11,64 %
D – Energieversorgung	4,10 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	4,93 %
F – Baugewerbe/Bau	2,91 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	11,70 %
H – Verkehr und Lagerei	9,23 %
J – Information und Kommunikation	20,21 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	15,18 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	7,42 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	7,51 %
S – Sonstige Dienstleistungen	5,16 %





## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Taxonomie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

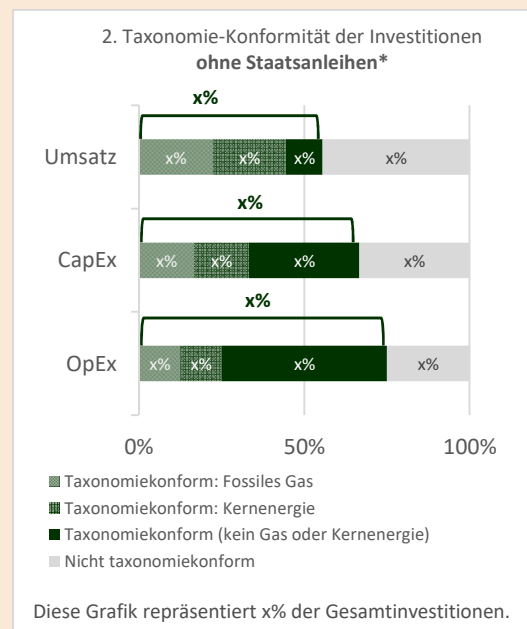
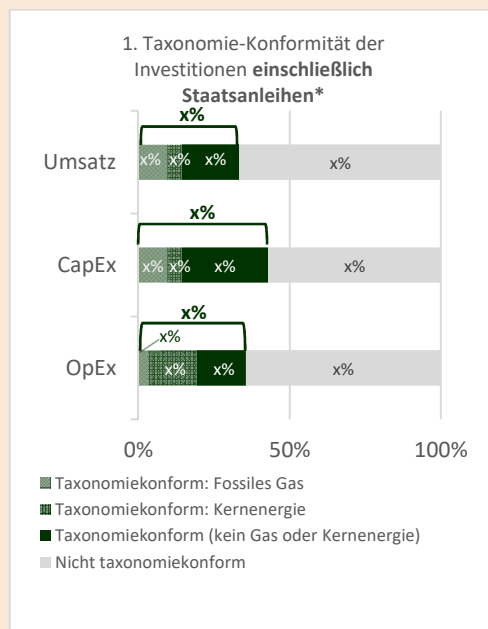
- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen ergriffen wurden.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Konnektivität der nächsten Generation fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes externes oder NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300XRT8BVEN8P0A74

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 61.32 %\* an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Im Zuge der Leitlinien der Europäischen Kommission zur Einstufung von Portfolios gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 („SFDR“) wurde das Portfolio am 19. August 2022 von einem Artikel-9-Portfolio in ein Artikel-8-Portfolio 8 umgestuft. Diese regelmäßige Offenlegung wurde daher auf Basis der Anforderungen erstellt, die für ein Artikel-8-Portfolio gemäß SFDR gelten.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Manager die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.<sup>1</sup>

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „NB-ESG-Quotient“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,24	100 %
Daten von Dritten	7,23	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 5,0 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 99 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von

der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ab dem 19. August 2022 investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, die mehr als 5% ihrer Umsätze über Hersteller von Pelz, Spezialleder oder militärische Auftragnehmer erzielten. Darüber hinaus schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Glücksspiele, Alkohol und Kernenergie. Ferner schloss das Portfolio Unternehmen aus, die in diktatorische Regime/große ESG-Kontroversen verwickelt waren, Unternehmen, die ein sehr schlechtes Verhalten in Bezug auf Umweltverschmutzung, Menschenrechtsfragen oder Governance-Kontroversen an den Tag legten, und Unternehmen, die in Bezug auf ESG nicht transparent waren oder bei ESG-Kennzahlen insgesamt sehr schlecht abschnitten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörtere und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:



- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbar Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens des Managers wurden Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: TH-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen und Beteiligungen an umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Ab dem 6. April 2022 berücksichtigte der Manager auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die durch das Portfolio beabsichtigten nachhaltigen Investitionen keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Ab dem 6. April 2022 investierte der Manager nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.

2. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und kontroverse Waffen für Unternehmensemittenten (zusammen die „PAIs auf Produktebene“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	5,9 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	5,4 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,5 %	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,4 %	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,9 %	USA
S&P GLOBAL INC	J – Information und Kommunikation	3,7 %	USA
BAKKAFROST	A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	3,3 %	Faröer Inseln
NIKE INC CLASS B	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,2 %	USA
3I GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,2 %	Großbritannien
NETFLIX INC	J – Information und Kommunikation	2,8 %	USA
ALFEN NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	Niederlande
ELEVANCE HEALTH INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,7 %	USA
BROWN & BROWN INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,7 %	USA
MOODYS CORP	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,7 %	USA
NASDAQ INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,7 %	USA

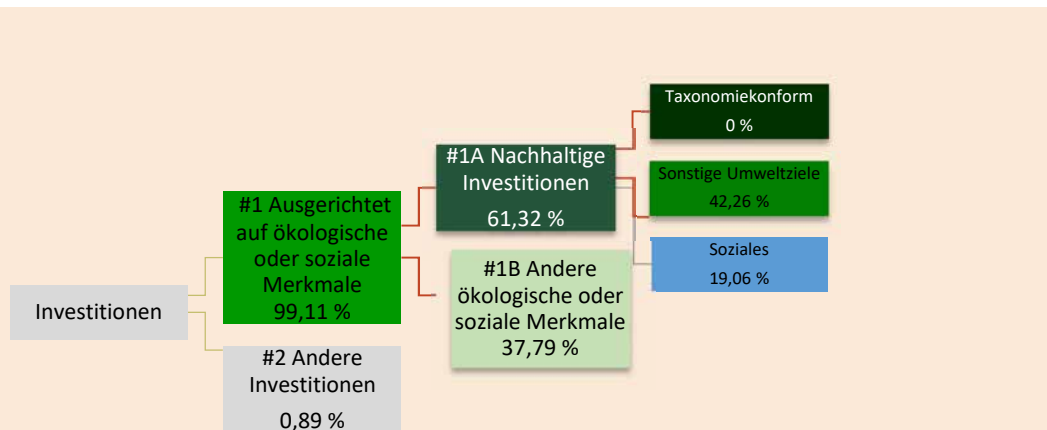


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	3,31 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	31,55 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	8,71 %
J – Information und Kommunikation	27,70 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	23,43 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	5,30 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

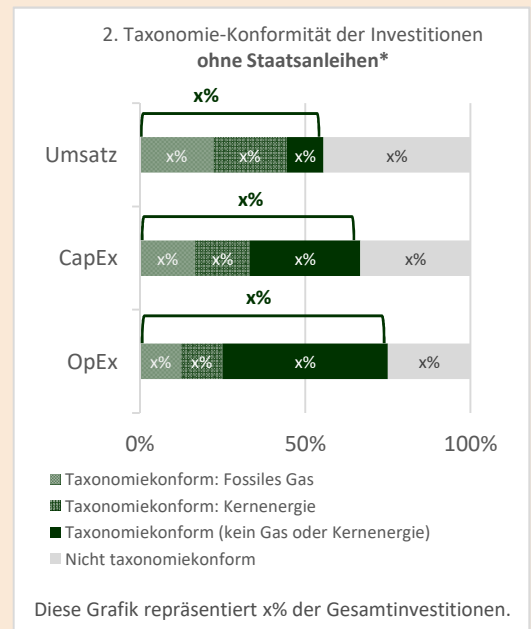
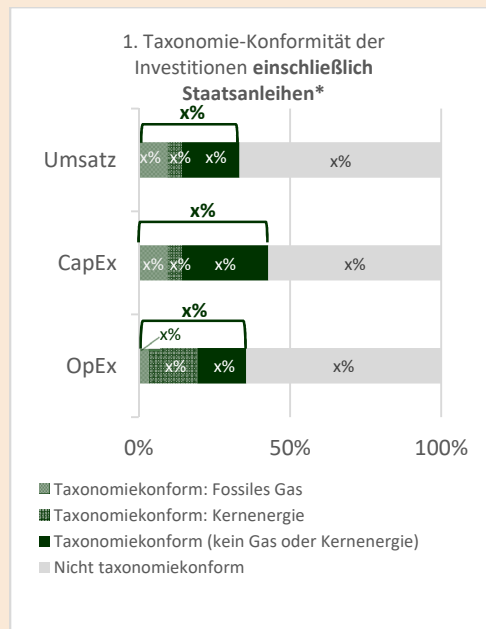
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?**

- Ja:  
 In fossiles Gas       In Kernenergie  
 Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

Taxonmie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

42,26 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

19,06 %



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

#### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Die NB-ESG-Quotient-Ratings wurden für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.



Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes externes oder NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

---

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300K7Y3HBTEX71857

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_%

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in  
Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 62,58\* % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale** beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Im Zuge der Leitlinien der Europäischen Kommission zur Einstufung von Portfolios gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 („SFDR“) wurde das Portfolio am 19. August 2022 von einem Artikel-9-Portfolio in ein Artikel-8-Portfolio 8 umgestuft. Diese regelmäßige Offenlegung wurde daher auf Basis der Anforderungen erstellt, die für ein Artikel-8-Portfolio gemäß SFDR gelten.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Manager die Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.<sup>1</sup>

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen in der Gemeinschaft, Datenschutz und -sicherheit, Arbeitnehmeranreize und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortliche Vermarktung.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „NB-ESG-Quotient“) wurden verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Der NB-ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

<sup>1</sup>Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

<b>31. Dezember 2022</b>	<b>Rating</b>	<b>Kombinierte Abdeckung</b>
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,52	100 %
Daten von Dritten	7,92	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance (G) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt und stellt keine Bewertung der Portfoliostrategie selbst dar.

Die Daten Dritter wurden ebenfalls zur Messung der durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale herangezogen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums – Climate Value-at-Risk (“**CVaR**”) erfasste das Ausmaß der Risiken des Übergangs und der physischen Klimarisiken. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Zum 31. Dezember 2022 prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 6,23 % führen könnte.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 99 %.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die

Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. April 2022 investierte das Portfolio zudem nicht mehr in Unternehmen, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstoßen. Ab dem 19. August 2022 investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, die mehr als 5% ihrer Umsätze über Hersteller von Pelz, Spezialleder oder militärische Auftragnehmer erzielten. Darüber hinaus schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Glücksspiele, Alkohol und Kernenergie. Ferner schloss das Portfolio Unternehmen aus, die in diktatorische Regime/große ESG-Kontroversen verwickelt waren, Unternehmen, die ein sehr schlechtes Verhalten in Bezug auf Umweltverschmutzung, Menschenrechtsfragen oder Governance-Kontroversen an den Tag legten, und Unternehmen, die in Bezug auf ESG nicht transparent waren oder bei ESG-Kennzahlen insgesamt sehr schlecht abschnitten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit

von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Als Teil des nachhaltigen Anlagerahmens des Managers wurden Anlagen, die die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich beeinträchtigen, ausgeschlossen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung: TH-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird, Anteil der Investitionen in Unternehmen mit Tätigkeit im Bereich der fossilen Brennstoffe, Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren, Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, Emissionen in Wasser, Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen und Beteiligungen an umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (die „PAIs“).

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Ab dem 6. April 2022 berücksichtigte der Manager auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

### ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die durch das Portfolio beabsichtigten nachhaltigen Investitionen keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

### ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Ab dem 6. April 2022 investierte der Manager nicht in Unternehmen, deren

Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Alle PAIs wurden dabei berücksichtigt festzustellen, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines der oben erläuterten ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele geführt haben.
2. Ab dem 28. November 2022 berücksichtigte der Manager die folgenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Bezug auf die Portfolioanlagen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerten, namentlich: THG-Emissionen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen, Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze und umstrittene Waffen(zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“).

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und



- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Die folgenden Daten sind zum 31. Dezember 2022.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
3I GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	5,6 %	Großbritannien
NESTLE SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,5 %	Schweiz
ASML HOLDING NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,0 %	Niederlande
NOVO NORDISK CLASS B	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,9 %	Dänemark
KERING SA	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,7 %	Frankreich
TECAN GROUP AG	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,6 %	Schweiz
BAKKAFROST	A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	4,0 %	Faröer Inseln
EURONEXT NV	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,0 %	Niederlande
ATLAS COPCO CLASS A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,9 %	Schweden
SCHNEIDER ELECTRIC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,9 %	Frankreich
PARTNERS GROUP HOLDING AG	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,9 %	Schweiz
ASSA ABLOY CLASS B	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,9 %	Schweden
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,8 %	Großbritannien
STRAUMANN HOLDING AG	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	Schweiz
SARTORIUS STEDIM BIOTECH SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,4 %	Frankreich



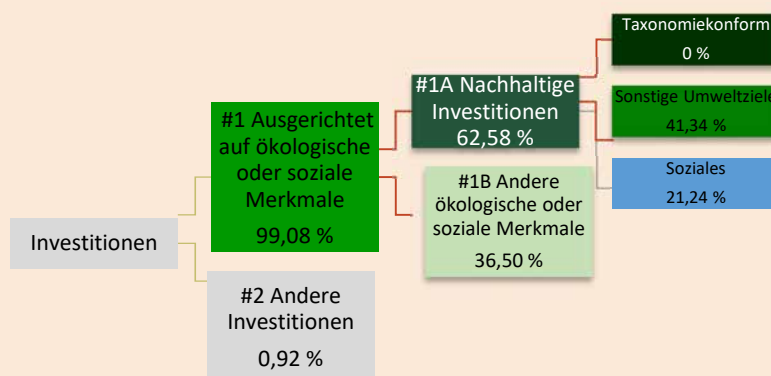
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten beruhen. Diese Berechnung basierte für lediglich den Bezugszeitraum 2022 auf den Beständen

des Portfolios zum 31. Dezember 2022, dem einzigen Quartalsende während des Bezugszeitraums, das auf die Veröffentlichung des SFDR-Anhangs des Portfolios folgte, in dem die geplante Vermögensallokation beschrieben wird. Für alle nachfolgenden Bezugszeiträume wird besagte Berechnung auf dem Durchschnitt der vier Quartalsenden basieren.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### ● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022	
Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	4,09 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	48,65 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	10,36 %
J – Information und Kommunikation	10,70 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	19,86 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	2,43 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,92 %



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

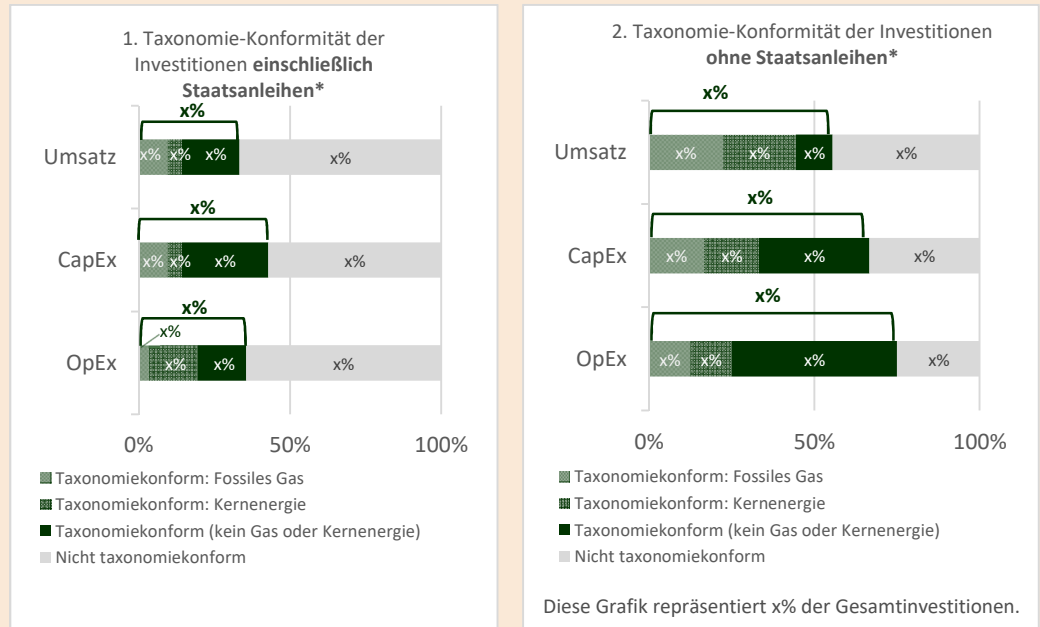
Nein

<sup>2</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

41,34 %

Das Portfolio investierte zwar in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel, diese nachhaltigen Investitionen waren jedoch nicht an der Taxonomie ausgerichtet.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

21,24 %



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Das NB-ESG-Quotient-Rating wurde für die im Portfolio gehaltenen Unternehmen erstellt. Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der wesentlichen ESG-Merkmale und der Portfoliokonstruktion im Rahmen der Anlagestrategie.

Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes externes oder NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Der Referenzwert des Portfolios wurde nicht als solcher festgelegt. Daher steht er nicht im Einklang mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

---

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k. A.

Dieses Dokument wird von der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) herausgegeben, die durch die irische Zentralbank (Irish Central Bank, „CBI“) zugelassen ist und reguliert wird und in Irland in 2 Central Plaza Dame Street, Dublin 2, eingetragen ist. Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz ist BNP Paribas Securities Services, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, 8002 Zürich, Schweiz. Erfüllungsort und Gerichtsstand für Anteile an den Teilfonds des Fonds, die in oder von der Schweiz aus angeboten oder vertrieben werden, ist der Sitz des Vertreters in der Schweiz. Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft, der letzte geprüfte Jahresabschluss und der danach veröffentlichte Halbjahresabschluss des Fonds sind kostenfrei vom Vertreter in der Schweiz zu beziehen.

Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) ist von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Vorschriften von 2011 zur Umsetzung der EG-Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. 352 of 2011) of Ireland) in der jeweils gültigen Fassung („OGAW-Vorschriften“) zugelassen.

Dieses Dokument wurde ausschließlich für Informationszwecke zur Verfügung gestellt und/oder richtet sich nur an Personen, bei denen es sich um professionelle Kunden oder zulässige Gegenparteien handelt. Alle Informationen können sich ohne Mitteilung ändern. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne die schriftliche Genehmigung von NBAMIL in irgendeiner Form vervielfältigt werden. Unternehmensdaten, wo relevant, einschließlich Zahlen zu Mitarbeitern und verwaltetem Vermögen, spiegeln die zusammengefassten Daten für die verschiedenen verbundenen Anlageberater wider, die Tochtergesellschaften der Neuberger Berman Group LLC (die „Gesellschaft“) sind. Die Daten aus der Historie/Zeitachse der Gesellschaft reichen zurück bis ins Jahr 1939, das Gründungsjahr von Neuberger & Berman (dem Vorgänger der Neuberger Berman Group LLC) und verdeutlichen die wesentlichen Expansionen des Unternehmens, einschließlich derer, die aus Übernahmen der verschiedenen verbundenen Anlageberater resultierten, die nun die Gesellschaft bilden. Zu den Anlageexperten auf die Bezug genommen wird, zählen Portfoliomanager, Researchanalysten/Partner, Händler und Produktspezialisten sowie ein Team aus spezialisierten Ökonomen/Strategen.

Neuberger Berman ist der Meinung, dass die Informationen zum Datum ihrer Erstellung richtig sind, aber Neuberger Berman gibt gegenüber dem Empfänger dieses Dokuments oder den Endnutzern diesbezüglich keinerlei Erklärungen oder Zusicherungen ab und übernimmt keinerlei Haftung für Handlungen, die auf Basis der hier enthaltenen Informationen durchgeführt werden. Entscheidungen sollten keinesfalls auf Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Informationen und Meinungen oder der Annahme, dass diese richtig oder vollständig sind, getroffen werden. Hierin zum Ausdruck gebrachte Meinungen entsprechen der Meinung der Neuberger Berman und können sich ohne Vorankündigung ändern. Der Fonds ist möglicherweise in manchen Ländern nicht zum Verkauf zugelassen und ist eventuell nicht für jeden Anlegertyp geeignet. Weitere Informationen sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Zusätzliche Informationen finden Sie auf [www.nb.com/europe/literature.html](http://www.nb.com/europe/literature.html).

Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen dem Risiko, dass ein Emittent seine mit der Verbindlichkeit verbundene Verpflichtung zu Kapital- und Zinszahlungen nicht erfüllen kann, und können infolge von Faktoren wie der Zinssensitivität, der Beurteilung der Kreditwürdigkeit des Emittenten durch den Markt und der allgemeinen Marktliquidität (Marktrisiko) Preisschwankungen unterliegen. Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen ferner dem Risiko, dass ihr Bonitätsrating oder das ihrer Emittenten herabgesetzt wird, was einen erheblichen Wertverlust solcher Wertpapiere zur Folge haben kann.

Wertpapiere mit niedrigem Rating (Non-Investment-Grade oder High Yield) oder Wertpapiere ohne Rating reagieren mit größerer Wahrscheinlichkeit auf Entwicklungen, die den Markt und das Kreditrisiko beeinflussen, als Wertpapiere mit höheren Ratings, die vor allem auf Veränderungen des allgemeinen Zinsniveaus reagieren. Anleger sollten die relativen Risiken einer Anlage in Hochzinspapieren sorgfältig analysieren und verstehen, dass solche Wertpapiere grundsätzlich nicht für eine kurzfristige Anlage geeignet sind. Anleger, die in einer anderen Währung als der Basiswährung des Fonds zeichnen, sind einem Währungsrisiko ausgesetzt. Schwankungen dieser Wechselkurse können die Kapitalrendite beeinträchtigen.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Indikator für künftige Ergebnisse. Einzelheiten zu den Anlagerisiken, insbesondere zum Liquiditäts-, Zins-, Kredit- und Währungsrisiko, sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Bitte beachten Sie, dass Dividenden/Zinsen, die der Fonds vereinnahmt, Quellensteuern unterliegen können. Die Benchmark berücksichtigt keine steuerlichen Auswirkungen, und deshalb wurde dieser Abzug nicht in der hierin angegebenen Benchmarkrendite berücksichtigt. Das Anlageziel und die Performancebenchmark sind nur ein Ziel und keine Garantie für die Wertentwicklung des Fonds. Der Index wird nicht gemanagt und ein direktes Investment in diesen ist nicht möglich. Indexrenditen gehen von einer Wiederanlage von Dividenden und Veräußerungsgewinnen aus und berücksichtigen im Gegensatz zu Fondsrenditen keine Gebühren oder Kosten. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Anlagen jedes Portfolios können vollständig gegenüber seiner Basiswährung abgesichert sein, was die Währungsrisiken reduzieren, das Portfolio aber anderen Risiken aussetzen kann – wie etwa einem Ausfall einer Gegenpartei. Wie vorstehend erwähnt, sind weitere Informationen zu den spezifischen mit dieser Strategie verbundenen Risiken dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen.

Neuberger Berman ist eine eingetragene Marke.

© 2023 Neuberger Berman